

**ALLIANCEBERNSTEIN®**

HALBJAHRESBERICHT

AB FCP I

Bestimmte Portefeuilles des Fonds sind nicht zum Angebot an nicht qualifizierte Anleger in der Schweiz zugelassen. Dementsprechend wurden alle Bezugnahmen auf diese Portefeuilles aus diesem verkürzten Halbjahresbericht entfernt. Die Anleger werden auf die Tatsache hingewiesen, dass bestimmte Zahlen in diesem verkürzten Halbjahresbericht auf konsolidierter Basis dargestellt sind und daher die Zahlen der Portefeuilles umfassen, die für das Angebot an nicht qualifizierte Anleger in der Schweiz nicht registriert sind.

Multi-Asset/Asset Allocation

- DYNAMIC DIVERSIFIED PORTFOLIO

Equity

- GLOBAL EQUITY BLEND PORTFOLIO
- GLOBAL VALUE PORTFOLIO
- EMERGING MARKETS GROWTH PORTFOLIO
- ASIA EX-JAPAN EQUITY PORTFOLIO
- JAPAN STRATEGIC VALUE PORTFOLIO
- CHINA LOW VOLATILITY EQUITY PORTFOLIO

Fixed Income

- SHORT DURATION BOND PORTFOLIO
- GLOBAL HIGH YIELD PORTFOLIO
- AMERICAN INCOME PORTFOLIO
- EUROPEAN INCOME PORTFOLIO
- EMERGING MARKETS DEBT PORTFOLIO
- MORTGAGE INCOME PORTFOLIO

AB FCP I ist ein offener Investmentfonds (*fonds commun de placement*), der gemäß den Gesetzen des Großherzogtums Luxemburg gegründet wurde und außerhalb von Österreich, Deutschland und der Schweiz unter dem Namen AllianceBernstein geschäftstätig ist.

Auf Grundlage der Berichte können keine Zeichnungsaufträge eingereicht werden. Zeichnungen sind nur wirksam, wenn sie auf Grundlage des Dokuments mit wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) und des aktuellen Verkaufsprospekts in Verbindung mit dem Jahresbericht oder dem jüngsten Halbjahresbericht, falls dieser später herausgegeben wurde, erfolgen.

	Seite
Brief an die Anteilhaber	1
Wertentwicklung der Anteile	2
Verzeichnis der Anlagewerte	12
Zusammensetzung des Fondsvermögens	138
Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens	142
Umlaufende Anteile	146
Statistische Informationen	153
Anmerkungen zum Halbjahresabschluss	170
Tabelle 1 – Gebührenstruktur	190
Tabelle 2 – Portefeuilleumsatz	202
Informationen für die Anteilhaber (ungeprüft)	203

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

20. März 2023

Sehr geehrte Anteilinhaber,

der vorliegende Bericht bietet Ihnen eine aktuelle Übersicht über AB FCP I (der „Fonds“) für den Halbjahresberichtszeitraum zum 28. Februar 2023.

In dem Sechsmonatszeitraum zum 28. Februar 2023 haben US-Aktien und internationale Aktien zugelegt, während Schwellenmarktaktien an Boden verloren. Als Reaktion auf die anhaltend hohe Inflation setzten die Zentralbanken, angeführt von der US-Notenbank („Fed“), die rasche Straffung der Geldpolitik fort, was die Sorgen der Anleger über einen Rückgang des Wirtschaftswachstums und die Wahrscheinlichkeit einer Rezession verstärkte. Nach einer Reihe aggressiver Zinsanhebungen ließ sich die Fed auf eine Erhöhung um 0.25% ein, bekräftigte jedoch ihre Haltung des „längerfristig höher“, was die Anlegerstimmung dämpfte.

Gegen Ende des Berichtszeitraums deuteten der nachlassende Druck auf die Lieferkette und günstigere Wirtschaftsdaten darauf hin, dass sich die Inflation abkühlte, und die Märkte erholten sich in Anbetracht der Zuversicht, dass eine Rezession vermieden werden könnte. Aktien gaben jedoch einige Gewinne wieder ab, nachdem unerwartet starke globale Wirtschaftsdaten für Unsicherheit über die Stärke des disinflationären Prozesses sorgten und Bedenken aufkamen, dass die wichtigsten Zentralbanken die Zinssätze länger als erwartet auf höherem Niveau halten würden. An den Large-Cap-Märkten stiegen wertorientierte Aktien und übertrafen wachstumsorientierte Aktien deutlich, die rückläufig waren, da steigende Zinsen die Wachstumsaktien im Großteil des Berichtszeitraums stärker unter Druck gesetzt hatten. Small-Cap-Aktien schlugen Large-Cap-Aktien auf relativer Basis, absolut gesehen stiegen aber beide.

Die Renditen am Markt für festverzinsliche Staatsanleihen zeigten sich im Berichtszeitraum wechselhaft, da die Anleger ihre Erwartungen im Hinblick auf die Inflation, das Wachstum

und die Ankündigungen von Straffungsmaßnahmen der Zentralbanken anpassten. Die meisten großen Zentralbanken in den Industrieländern setzten die aggressive Straffung ihrer Geldpolitik fort, indem sie die kurzfristigen Zinssätze erhöhten und die Anleihekäufe beendeten, um die hohe und anhaltende Inflation zu bekämpfen.

Die Renditen von Staatsanleihen aus Industrieländern fielen im Vereinigten Königreich und in Deutschland am stärksten, gingen in Japan am wenigsten zurück und stiegen in Australien und Kanada. Verbriefte Vermögenswerte entwickelten sich im Allgemeinen besser als Staatsanleihen. In Sektoren mit Kreditrisiko entwickelten sich Staatsanleihen mit Anlagequalität rückläufig, lieferten aber eine deutliche Outperformance gegenüber globalen Staatsanleihen und übertrafen die jeweiligen Staatsanleihenmärkte im Euroraum und in den USA. Globale hochverzinsliche Industrieschuldverschreibungen aus Industrieländern boten positive Renditen und ließen die Staatsanleihen aus Industrieländern weit hinter sich.

Schwellenmarktanleihen in Lokalwährung führten die Renditen im Kreditsektor mit starken Ergebnissen an, da sich der US-Dollar gegenüber den Währungen von Industrie- und Schwellenmärkten uneinheitlich entwickelte. In US-Dollar abgesicherte Staatsanleihen und Industrieschuldverschreibungen aus Schwellenmärkten in Hartwährung lieferten positive Renditen und ließen die Staatsanleihen aus Industrieländern weit hinter sich. Hochverzinsliche Schwellenmarktanleihen in Hartwährung erzielten ebenfalls positive Renditen und übertrafen Schwellenmarktschuldtitle mit Anlagequalität, die nachgaben. Die Rohölpreise für Brent gaben aufgrund der Sorge um das globale Wachstum und der verringerten Nachfrage stark nach.

Wir danken Ihnen für Ihre Anlage in den Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l., die Verwaltungsgesellschaft des Fonds (die „Verwaltungsgesellschaft“)

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<u>Dynamic Diversified Portfolio</u>				
Klasse				
A	-0.05%	-10.11%	-16.30%	35.13%
A EUR	-5.05%	-4.72%	-1.66%	84.23%
A EUR H	-1.90%	-13.12%	-17.92%	13.87%
AX	0.00%	-10.08%	-16.30%	63.00%
AX EUR	-5.01%	-4.70%	-1.62%	95.85%
AX SGD	-3.54%	-10.57%	-12.98%	27.82%
BX	-0.54%	-11.00%	-17.08%	35.87%
C	-0.20%	-10.39%	-16.56%	31.07%
C EUR	-5.15%	-5.01%	-2.00%	78.75%
C EUR H	-2.07%	-13.58%	-18.33%	10.27%
CX	-0.17%	-10.37%	-16.52%	55.07%
I	0.28%	-9.52%	-15.74%	45.67%
I EUR	-4.71%	-4.09%	-1.00%	98.65%
I EUR H	-1.55%	-12.49%	-17.32%	22.80%
IX	0.33%	-9.47%	-15.69%	83.67%
<u>Global Equity Blend Portfolio</u>				
Klasse				
A	4.25%	-10.73%	-21.74%	140.50%
A EUR	-0.96%	-5.33%	-8.05%	167.85%
A EUR H	2.03%	-14.37%	-23.68%	37.47%
A SGD	0.59%	-11.19%	-18.65%	55.98%
B	3.77%	-11.57%	-22.53%	98.00%
B SGD	0.11%	-12.05%	-19.46%	30.92%
C	4.02%	-11.10%	-22.09%	85.74%
C EUR	-1.11%	-5.57%	-	-10.73%
I	4.68%	-9.96%	-21.11%	182.00%
I EUR	-0.52%	-4.55%	-7.33%	214.02%
S HKD	5.30%	-8.47%	-19.45%	164.51%
S1	4.90%	-9.53%	-20.73%	172.68%
S1 EUR	-0.31%	-4.08%	-6.88%	220.79%
S1 GBP	1.34%	0.90%	-6.19%	273.36%
S1 SGD	1.24%	-9.99%	-17.61%	89.57%
<u>Global Value Portfolio</u>				
Klasse				
A	7.32%	-7.59%	-18.42%	93.50%
A EUR	2.01%	-2.04%	-4.22%	63.45%
A SGD	3.61%	-8.09%	-15.23%	0.62%
A SGD H	6.51%	-8.79%	-18.85%	28.67%
AD	7.38%	-7.60%	-18.48%	34.04%
AD AUD H	5.35%	-10.54%	-19.70%	25.56%
AD CAD H	6.53%	-8.87%	-19.03%	23.95%
AD EUR H	5.05%	-11.04%	-20.18%	14.41%
AD GBP H	5.82%	-9.91%	-19.40%	18.76%
AD HKD	7.35%	-7.19%	-17.70%	36.42%
AD ZAR H	8.07%	-6.01%	-15.47%	91.54%
B	6.85%	-8.51%	-19.26%	55.90%
C	7.07%	-8.04%	-18.79%	82.31%
C EUR	1.82%	-2.45%	-4.64%	101.20%
I	7.77%	-6.84%	-17.78%	128.80%
I EUR	2.37%	-1.23%	-3.34%	85.51%
I GBP	4.10%	3.96%	-	1.53%
I SGD	3.97%	-7.35%	-14.54%	14.50%
S	8.22%	-6.03%	-17.05%	79.96%
S GBP	4.49%	4.78%	-1.82%	173.45%
S GBP H	6.74%	-8.27%	-17.95%	38.20%
S1	7.82%	-6.69%	-17.64%	94.67%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Global Value Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
S1 AUD H	15.58%(1)	–	–	15.58%
S1 EUR	2.52%	-1.04%	-3.22%	146.97%
S1 GBP	4.21%	4.10%	-2.53%	217.56%
SD	8.23%	-6.02%	-17.06%	58.54%

Emerging Markets Growth Portfolio

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Klasse				
A	-1.86%	-13.55%	-23.98%	316.70%
A AUD H	-3.71%	-16.37%	-25.39%	17.53%
A EUR	-6.77%	-8.37%	-10.68%	139.54%
A HKD	-1.85%	-13.17%	-23.28%	24.65%
A PLN H	-0.30%	-12.23%	-23.96%	-5.50%
A SGD	-5.29%	-14.02%	-20.98%	32.08%
A SGD H	-2.64%	-14.60%	-24.38%	-6.40%
AD	-1.88%	-13.55%	-23.97%	16.18%
B	-2.36%	-14.42%	-24.73%	209.70%
C	-2.07%	-13.93%	-24.31%	117.85%
C EUR	-6.94%	-8.76%	-11.10%	111.08%
ED	-2.34%	-14.40%	-24.69%	-18.51%
I	-1.48%	-12.86%	-23.36%	188.36%
I AUD H	-3.25%	-15.52%	-24.69%	28.87%
I EUR	-6.37%	-7.62%	-9.98%	186.47%
N	-2.02%	-13.89%	-24.33%	35.93%
S1	-1.38%	-12.72%	-23.24%	161.54%
S1 EUR	-6.26%	-7.39%	-9.75%	220.37%
S1 GBP	-4.73%	-2.56%	-9.08%	302.53%

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Klasse				
A	-0.91%	-17.28%	-20.72%	44.60%
A AUD H	-2.91%	-19.79%	-21.81%	40.20%
A EUR	-5.83%	-12.32%	-6.89%	105.21%
A HKD	-0.91%	-16.92%	-19.99%	46.45%
A SGD H	-1.85%	-18.30%	-21.00%	2.67%
AD	-0.92%	-17.31%	-20.75%	44.63%
AD AUD H	-2.86%	-19.80%	-21.86%	40.47%
AD CAD H	-1.77%	-18.42%	-21.36%	1.82%
AD EUR	-5.82%	-12.32%	-6.86%	105.36%
AD EUR H	-3.10%	-20.34%	-22.32%	1.33%
AD GBP H	-2.40%	-19.25%	-21.63%	13.68%
AD HKD	-0.92%	-16.92%	-19.98%	46.53%
AD NZD H	-2.70%	-19.26%	-21.20%	33.37%
AD RMB H	-2.97%	-18.74%	-19.38%	39.94%
AD ZAR H	-0.64%	-16.08%	-18.06%	95.46%
AY JPY	-2.90%	-2.04%	0.12%	112.75%
BY JPY	-3.13%	-2.50%	-0.35%	101.77%
C	-1.16%	-17.69%	-21.08%	36.20%
C EUR	-6.13%	-12.78%	-7.22%	93.29%
ED	-1.42%	-18.15%	-21.50%	-14.23%
ED AUD H	-3.33%	-9.47%(2)	–	-9.47%
I	-0.50%	-16.59%	-20.07%	60.87%
I AUD H	-2.51%	-19.15%	-21.18%	58.20%
I EUR	-5.51%	-11.63%	-6.11%	128.23%
I GBP	-3.97%	-7.02%	-5.41%	50.13%
S	-0.03%	-15.76%	-19.23%	85.60%
S HKD	-0.01%	-15.38%	-18.49%	63.49%
S1	-0.48%	-16.52%	-19.96%	64.40%
S1 EUR	-5.39%	-11.46%	-5.95%	133.53%
SD	-0.03%	-15.76%	-19.23%	50.75%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Japan Strategic Value Portfolio				
Klasse				
A	1.88%	5.94%	3.04%	22.57%
A CZK H	5.20%	11.46%	6.03%	6.26%
A EUR	-1.21%	-5.15%	-4.17%	18.54%
A EUR H	2.24%	5.72%	1.92%	88.40%
A PLN	-1.61%	-5.22%	0.12%	-2.81%
A SGD	0.31%	-11.03%	-15.19%	-11.80%
A SGD H	3.59%	8.15%	3.41%	19.40%
A USD	3.96%	-10.54%	-18.40%	4.84%
A USD H	3.94%	8.69%	3.63%	137.53%
AD	1.88%	5.95%	3.04%	52.00%
AD AUD H	2.87%	6.85%	2.66%	55.55%
AD NZD H	3.50%	7.90%	3.30%	66.67%
AD USD H	3.92%	8.67%	3.65%	50.15%
AD ZAR H	5.15%	12.06%	8.05%	141.38%
C	1.42%	5.00%	2.28%	13.63%
C EUR	-1.68%	-6.02%	-4.84%	17.74%
C EUR H	1.78%	4.74%	1.18%	75.13%
C USD	3.49%	-11.34%	-19.01%	-2.69%
I	2.24%	6.75%	3.89%	40.68%
I EUR	-0.85%	-4.38%	-3.32%	45.82%
I EUR H	2.63%	6.54%	2.73%	108.40%
I SGD	0.71%	-10.31%	-14.51%	0.49%
I USD	4.36%	-9.83%	-17.74%	20.48%
I USD H	4.34%	9.53%	4.44%	159.87%
S EUR H	2.99%	7.29%	3.68%	109.13%
S1 EUR	-0.78%	-4.32%	-3.12%	43.81%
S1 USD	4.42%	-9.73%	-17.54%	27.16%
SD	2.66%	7.60%	4.81%	85.56%
China Low Volatility Equity Portfolio				
Klasse				
A	-3.63%	-17.90%	-25.97%	359.50%
A EUR	-8.43%	-12.96%	-13.02%	164.07%
A HKD	-3.62%	-17.53%	-25.30%	15.90%
A PLN H	-2.42%	-15.70%	-24.96%	-21.38%
AD	-3.63%	-17.87%	-25.96%	20.93%
AD AUD H	-5.58%	-20.29%	-27.00%	11.09%
AD CAD H	-4.19%	-18.81%	-26.67%	10.15%
AD EUR H	-5.74%	-21.08%	-27.63%	0.74%
AD GBP H	-4.94%	-19.73%	-26.86%	6.97%
AD HKD	-3.61%	-17.52%	-25.30%	23.52%
AD NZD H	-5.48%	-19.71%	-26.34%	16.98%
AD SGD H	-4.57%	-18.94%	-26.26%	12.22%
AD ZAR H	-3.60%	-17.17%	-24.07%	66.12%
B	-4.11%	-18.71%	-26.71%	256.60%
B EUR	-8.89%	-13.83%	-13.89%	119.18%
C	-3.82%	-18.26%	-26.32%	4.63%
C EUR	-8.63%	-13.36%	-13.43%	28.69%
I	-3.26%	-17.24%	-25.38%	460.70%
I EUR	-8.06%	-12.25%	-12.33%	206.30%
S	-2.73%	-16.37%	-24.61%	144.88%
S1	-3.10%	-17.00%	-25.17%	106.45%
S1 EUR	-7.94%	-12.00%	-12.08%	171.40%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Short Duration Bond Portfolio				
Klasse				
A	0.14%	-2.02%	-3.93%	111.27%
A EUR	-4.96%	3.72%	12.85%	25.86%
A2	0.00%	-2.10%	-3.85%	70.09%
A2 EUR	-4.98%	3.84%	12.99%	25.60%
A2 EUR H	-1.38%	-4.45%	-5.18%	-9.73%
A2 HKD	0.04%	-1.63%	-2.98%	30.01%
AA	0.04%	-2.03%	-3.84%	-0.10%
AA AUD H	-0.64%	-2.99%	-4.18%	-2.72%
AA CAD H	-0.12%	-2.26%	-3.90%	-2.39%
AA GBP H	-0.56%	-2.90%	-4.11%	-6.52%
AA HKD	0.04%	-1.63%	-2.98%	1.13%
AA SGD H	-0.24%	-2.31%	-3.84%	-1.83%
AJ	0.20%	-1.84%	-3.72%	88.86%
AT	0.15%	-2.01%	-3.94%	53.10%
AT AUD H	-0.67%	-3.08%	-4.26%	18.78%
AT CAD H	-0.09%	-2.16%	-3.88%	3.51%
AT EUR	-4.95%	3.89%	13.03%	64.77%
AT EUR H	-1.34%	-4.36%	-5.18%	-10.53%
AT GBP H	-0.51%	-2.90%	-4.18%	-3.58%
AT HKD	0.05%	-1.62%	-2.97%	29.92%
AT NZD H	-0.25%	-2.26%	-3.60%	9.43%
AT SGD H	-0.24%	-2.38%	-3.85%	-2.73%
AX	0.10%	-1.93%	-3.62%	176.87%
B	-0.50%	-3.00%	-4.76%	61.83%
C	-0.20%	-2.42%	-4.20%	50.76%
C2	-0.14%	-2.42%	-4.27%	47.02%
C2 EUR H	-1.46%	-4.69%	-5.53%	-14.73%
I	0.31%	-1.42%	-3.23%	139.13%
I EUR	-4.79%	4.36%	13.69%	42.75%
I2	0.31%	-1.45%	-3.23%	39.89%
I2 EUR	-4.68%	4.44%	13.64%	68.92%
I2 EUR H	-1.09%	-3.77%	-4.61%	-3.07%
IT	0.34%	-1.40%	-3.24%	4.54%
N2	-0.21%	-2.56%	-4.34%	-6.27%
NT	-0.23%	-2.55%	-4.28%	-6.36%
S	0.57%	-0.99%	-2.82%	1.04%
S1 2	0.49%	-1.20%	-3.08%	9.60%
S1 2 EUR	-4.55%	4.72%	13.93%	29.39%
SA	0.58%	-0.99%	-2.81%	11.70%

Global High Yield Portfolio

Klasse				
A	3.15%	-5.65%	-13.42%	222.67%
A EUR	-1.91%	-0.28%	1.71%	175.32%
A2	3.18%	-5.85%	-13.50%	252.15%
A2 CHF H	0.99%	-9.18%	-15.15%	-5.00%
A2 EUR	-1.93%	-0.20%	1.62%	193.82%
A2 EUR H	1.41%	-8.74%	-15.02%	44.13%
A2 HKD	3.21%	-5.43%	-12.74%	180.53%
A2 PLN H	4.78%	-3.11%	-11.86%	0.35%
A2 SGD	-0.43%	-6.40%	-10.12%	52.54%
A2 SGD H	2.60%	-6.68%	-13.76%	34.20%
AA	3.18%	-5.81%	-13.48%	18.18%
AA AUD H	2.06%	-7.76%	-14.44%	15.58%
AA CAD H	2.75%	-6.52%	-13.80%	7.95%
AA EUR H	1.39%	-8.74%	-15.03%	-3.01%
AA GBP H	1.98%	-7.68%	-14.32%	3.07%
AA HKD	3.21%	-5.43%	-12.73%	15.95%
AA NZD H	2.38%	-7.01%	-13.84%	16.56%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
AA RMB H	1.77%	-6.76%	-12.04%	31.45%
AA SGD H	2.57%	-6.75%	-13.73%	12.21%
AA ZAR H	4.27%	-3.43%	-10.03%	74.14%
AK	3.19%	-5.86%	-13.47%	22.40%
AK EUR	-1.96%	-0.18%	1.56%	50.56%
AK EUR H	1.35%	-8.86%	-15.06%	3.58%
AR EUR H	1.29%	-8.85%	-15.05%	-1.60%
AT	3.51%	-5.73%	-13.61%	293.92%
AT AUD H	1.98%	-7.76%	-14.38%	77.98%
AT CAD H	2.79%	-6.48%	-13.90%	34.85%
AT EUR	-1.95%	-0.32%	1.69%	145.09%
AT EUR H	1.33%	-8.76%	-15.00%	43.31%
AT GBP H	2.02%	-7.63%	-14.29%	35.49%
AT HKD	3.21%	-5.42%	-12.72%	180.96%
AT NZD H	2.36%	-7.11%	-13.81%	35.04%
AT RMB H	1.77%	-6.79%	-12.06%	65.88%
AT SGD	-0.57%	-6.44%	-10.04%	85.13%
AT SGD H	2.58%	-6.64%	-13.75%	34.01%
B	2.52%	-6.76%	-14.35%	146.14%
B2	2.71%	-6.78%	-14.39%	215.64%
BT	2.54%	-6.90%	-14.40%	144.09%
BT AUD H	1.54%	-8.59%	-15.21%	56.87%
C	2.83%	-6.23%	-13.88%	171.74%
C EUR	-2.17%	-0.47%	1.22%	142.89%
C2	2.98%	-6.32%	-13.99%	117.80%
C2 EUR	-2.19%	-0.68%	1.11%	166.02%
C2 EUR H	1.13%	-9.22%	-15.45%	12.93%
CK	2.88%	-6.38%	-13.93%	16.67%
CK EUR H	1.04%	-9.24%	-15.45%	-0.94%
CT	2.92%	-6.37%	-13.96%	29.90%
EA	2.93%	-6.37%	-13.98%	-0.35%
EA AUD H	1.84%	-8.20%	-14.90%	-7.71%
EA ZAR H	4.02%	-3.92%	-10.50%	11.12%
I	3.15%	-5.64%	-12.93%	272.83%
I EUR	-1.63%	0.28%	2.25%	210.83%
I2	3.50%	-5.37%	-13.07%	101.81%
I2 AUD H	2.24%	-7.29%	-13.99%	76.47%
I2 CHF H	1.23%	-8.79%	-14.77%	-1.07%
I2 EUR	-1.66%	0.32%	2.11%	160.27%
I2 EUR H	1.63%	-8.30%	-14.62%	53.93%
I2 SGD	-0.15%	-5.90%	-9.65%	59.91%
I2 SGD H	2.87%	-6.20%	-13.36%	17.00%
IA AUD H	2.22%	-7.41%	-14.03%	21.16%
IQD	3.52%	-5.38%	-13.15%	48.47%
IT	3.41%	-5.36%	-13.09%	26.79%
IT AUD H	2.23%	-7.31%	-14.03%	26.55%
IT CAD H	2.99%	-6.11%	-13.39%	21.55%
IT EUR H	1.64%	-8.31%	-14.62%	-8.32%
IT GBP H	2.25%	-7.17%	-13.77%	16.71%
IT HKD	3.48%	-4.95%	-12.30%	28.21%
IT RMB H	1.98%	-6.32%	-11.60%	43.60%
J	2.88%	-6.68%	-14.47%	155.60%
N2	2.93%	-6.37%	-14.02%	19.53%
NT	2.85%	-6.42%	-13.96%	19.61%
S1	3.60%	-5.18%	-12.95%	80.53%
S1 EUR	-1.61%	0.51%	2.32%	107.79%
S1D	3.56%	-5.23%	-12.94%	48.79%
S1D2	6.87%(3)	-	-	6.87%
SA	4.03%	-4.33%	-12.14%	35.25%
SHK	4.04%	-4.30%	-12.12%	34.21%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
SK	3.69%	-4.95%	-12.72%	143.40%
W	3.51%	-5.18%	-12.87%	-0.09%
W EUR	-1.63%	0.49%	2.28%	4.65%
W2	3.53%	-5.24%	-12.97%	3.73%
W2 CHF H	1.27%	-8.63%	-14.56%	-9.67%
W2 EUR H	1.75%	-8.24%	-14.61%	-7.20%
WT	3.55%	-5.23%	-12.99%	3.74%
WT AUD H	2.45%	-7.08%	-13.94%	-3.28%
WT CAD H	3.08%	-5.95%	-13.25%	-3.05%
WT EUR H	1.71%	-8.15%	-14.48%	-8.23%
WT GBP H	2.34%	-7.03%	-13.66%	-5.15%
WT RMB H	2.04%	-6.15%	-11.44%	2.58%
American Income Portfolio				
Klasse				
A	-0.29%	-8.86%	-13.08%	347.65%
A EUR	-5.17%	-3.35%	1.97%	112.57%
A2	-0.28%	-8.88%	-13.15%	219.55%
A2 CHF H	-2.60%	-12.25%	-14.83%	-4.93%
A2 DUR PH	5.28%	2.94%	-4.61%	26.27%
A2 EUR	-5.22%	-3.38%	2.01%	110.74%
A2 EUR H	-2.06%	-11.67%	-14.66%	14.07%
A2 HKD	-0.25%	-8.45%	-12.37%	95.45%
A2 PLN H	1.27%	-5.88%	-11.26%	-1.19%
A2 SGD	-3.74%	-9.35%	-9.75%	35.56%
A2 SGD H	-0.78%	-9.53%	-13.32%	27.87%
AA	-0.29%	-8.87%	-13.19%	17.81%
AA AUD H	-1.43%	-10.55%	-13.83%	17.74%
AA CAD H	-0.67%	-9.47%	-13.38%	8.54%
AA DUR PH	5.25%	2.91%	-4.63%	25.26%
AA EUR H	-1.98%	-11.63%	-14.66%	-3.77%
AA GBP H	-1.38%	-10.39%	-13.77%	3.20%
AA HKD	-0.25%	-8.47%	-12.38%	14.70%
AA NZD H	-1.09%	-9.86%	-13.30%	17.13%
AA RMB H	-1.65%	-9.74%	-11.68%	30.64%
AA SGD H	-0.79%	-9.59%	-13.38%	12.05%
AA ZAR H	0.80%	-6.32%	-9.43%	76.95%
AK	-0.28%	-8.88%	-13.16%	16.81%
AK EUR	-5.21%	-3.34%	2.06%	43.85%
AK EUR H	-2.14%	-11.65%	-14.62%	-0.73%
AR EUR	-5.19%	-3.38%	1.99%	19.09%
AR EUR H	-2.11%	-11.70%	-14.60%	-5.56%
AT	-0.28%	-8.86%	-13.19%	146.30%
AT AUD H	-1.42%	-10.54%	-13.87%	55.04%
AT CAD H	-0.60%	-9.47%	-13.47%	29.75%
AT DUR PH	5.30%	2.92%	-4.62%	26.20%
AT EUR	-5.32%	-3.50%	2.12%	126.24%
AT EUR H	-2.09%	-11.64%	-14.63%	15.66%
AT GBP H	-1.36%	-10.42%	-13.70%	17.39%
AT HKD	-0.24%	-8.45%	-12.38%	95.41%
AT NZD H	-1.06%	-9.81%	-13.27%	26.62%
AT RMB H	-1.68%	-9.76%	-11.68%	49.40%
AT SGD	-3.78%	-9.41%	-9.73%	52.03%
AT SGD H	-0.69%	-9.48%	-13.36%	27.88%
B	-0.58%	-9.51%	-13.75%	262.74%
B2	-0.62%	-9.51%	-13.76%	166.19%
BT	-0.70%	-9.53%	-13.73%	115.49%
C	-0.43%	-9.23%	-13.52%	279.35%
C EUR	-5.39%	-3.66%	1.65%	89.51%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
American Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
C2	-0.49%	-9.27%	-13.55%	278.30%
C2 DUR PH	4.99%	2.43%	-5.01%	20.73%
C2 EUR	-5.41%	-3.79%	1.54%	90.16%
C2 EUR H	-2.23%	-12.00%	-15.02%	8.07%
CT	-0.41%	-9.25%	-13.56%	17.17%
EA	-0.47%	-9.32%	-13.64%	-3.61%
EA AUD H	-1.59%	-10.88%	-14.28%	-9.41%
EA ZAR H	0.56%	-6.79%	-9.92%	9.79%
I	-0.10%	-8.40%	-12.55%	247.20%
I EUR	-4.89%	-2.79%	2.53%	139.31%
I2	0.00%	-8.35%	-12.70%	103.33%
I2 AUD H	-1.07%	-9.97%	-13.42%	-1.27%
I2 CHF H	-2.27%	-11.75%	-14.37%	0.60%
I2 DUR PH	5.56%	3.51%	-4.05%	31.60%
I2 EUR	-4.93%	-2.82%	2.59%	147.93%
I2 EUR H	-1.79%	-11.17%	-14.16%	24.60%
I2 HKD	0.03%	-7.95%	-11.90%	19.27%
I2 SGD	-3.46%	-8.80%	-9.21%	44.14%
I2 SGD H	-0.52%	-9.09%	-12.88%	15.33%
IA	-0.02%	-8.40%	-12.70%	19.43%
IA AUD H	-1.15%	-9.99%	-13.38%	15.00%
IT	-0.04%	-8.41%	-12.66%	23.49%
IT AUD H	-1.07%	-9.96%	-13.42%	22.72%
IT CAD H	-0.37%	-8.96%	-12.88%	14.02%
IT EUR H	-1.86%	-11.16%	-14.13%	2.21%
IT GBP H	-1.19%	-9.96%	-13.28%	9.16%
IT HKD	0.02%	-7.95%	-11.89%	24.47%
IT JPY	-1.97%	8.55%	10.27%	65.25%
IT JPY H	-2.44%	-11.65%	-13.89%	3.02%
IT NZD H	-0.84%	-9.39%	-12.83%	17.95%
IT RMB H	-1.39%	-9.26%	-11.20%	1.20%
IT SGD	-3.51%	-8.84%	-9.23%	11.87%
IT SGD H	-0.48%	-9.01%	-12.83%	22.28%
J	-0.52%	-9.49%	-13.77%	172.92%
L2	-0.14%	-8.62%	-12.95%	-6.00%
LT	-0.14%	-8.62%	-12.94%	-6.00%
N2	-0.54%	-9.37%	-13.67%	10.93%
NT	-0.55%	-9.34%	-13.62%	10.95%
S	0.35%	-7.71%	-12.05%	33.27%
S1	0.13%	-8.15%	-12.51%	47.93%
S1D	0.16%	-8.14%	-12.51%	35.47%
S1D2	0.13%	-8.16%	-12.50%	-7.80%
SA	0.38%	-7.69%	-12.06%	29.71%
SHK	0.38%	-7.66%	-12.03%	23.27%
W	0.12%	-8.17%	-12.50%	5.29%
W2	0.13%	-8.18%	-12.56%	5.47%
W2 CHF H	-2.20%	-11.63%	-14.22%	-8.33%
W2 EUR H	-1.75%	-11.03%	-13.97%	-6.40%
WT	0.05%	-8.22%	-12.53%	5.44%
WT AUD H	-1.04%	-9.84%	-13.25%	-0.36%
WT EUR H	-1.74%	-11.05%	-14.02%	-8.94%
WT GBP H	-0.93%	-9.74%	-13.17%	-6.47%
WT HKD	0.11%	-7.82%	-11.75%	5.84%
WT SGD H	-0.34%	-8.81%	-12.74%	2.31%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
European Income Portfolio				
Klasse				
A	-0.10%	-8.96%	-13.13%	93.45%
A USD	5.18%	-14.01%	-26.03%	86.57%
A2	-0.16%	-8.92%	-13.14%	92.00%
A2 CHF H	-0.54%	-9.36%	-13.38%	-2.53%
A2 PLN H	3.22%	-2.97%	-9.69%	3.30%
A2 USD	5.07%	-14.09%	-26.05%	87.53%
A2 USD H	1.54%	-6.22%	-11.73%	18.67%
AA	-0.15%	-8.86%	-13.09%	9.25%
AA AUD H	0.40%	-7.89%	-12.45%	27.01%
AA HKD H	1.05%	-7.15%	-12.24%	18.45%
AA RMB H	0.20%	-7.09%	-10.18%	32.91%
AA SGD H	1.03%	-6.89%	-11.91%	21.43%
AA USD H	1.57%	-6.24%	-11.77%	26.40%
AK	-0.16%	-8.92%	-13.17%	14.15%
AR	-0.10%	-8.84%	-13.14%	2.21%
AT	-0.11%	-8.97%	-13.26%	88.06%
AT AUD H	0.42%	-7.87%	-12.48%	75.82%
AT SGD H	1.04%	-6.86%	-11.91%	21.43%
AT USD	5.18%	-14.01%	-26.12%	32.59%
AT USD H	1.55%	-6.27%	-11.78%	59.30%
B USD	4.83%	-14.55%	-26.52%	57.39%
B2	-0.49%	-9.50%	-13.75%	62.90%
B2 USD	4.74%	-14.66%	-26.60%	56.35%
C	-0.38%	-9.29%	-13.41%	70.62%
C USD	4.84%	-14.40%	-26.31%	65.54%
C2	-0.39%	-9.30%	-13.52%	80.40%
C2 USD	4.84%	-14.48%	-26.40%	76.18%
C2 USD H	1.32%	-6.64%	-12.14%	12.47%
CK	-0.36%	-9.29%	-13.51%	9.48%
CT USD H	1.42%	-6.62%	-12.22%	12.59%
I	0.23%	-8.38%	-12.62%	120.97%
I USD	5.24%	-13.67%	-25.55%	179.57%
I2	0.15%	-8.40%	-12.67%	73.53%
I2 AUD H	0.75%	-7.38%	-12.01%	88.40%
I2 CHF H	-0.27%	-8.80%	-12.90%	0.13%
I2 USD	5.37%	-13.54%	-25.63%	44.07%
I2 USD H	1.83%	-5.72%	-11.28%	70.33%
IA	0.11%	-8.39%	-12.64%	7.69%
IA HKD H	1.38%	-6.54%	-11.72%	19.96%
IA SGD H	1.31%	-6.34%	-11.37%	20.29%
IA USD H	1.80%	-5.75%	-11.25%	24.50%
IT	0.16%	-8.33%	-12.65%	7.64%
IT SGD H	1.35%	-6.36%	-11.44%	20.40%
IT USD H	1.85%	-5.74%	-11.31%	26.93%
NT USD H	1.28%	-6.80%	-12.29%	5.65%
S1	0.24%	-8.18%	-12.47%	54.94%
S1 USD	5.47%	-13.40%	-25.48%	21.50%
S1 USD H	1.95%	-5.47%	-11.06%	60.13%
S1D	0.22%	-8.25%	-12.50%	9.73%
SA USD H	2.22%	-5.04%	-10.65%	40.20%
SHK	0.50%	-7.67%	-12.01%	13.55%
W2	0.21%	-8.25%	-12.52%	-6.60%
W2 CHF H	-0.21%	-8.70%	-12.75%	-3.47%
W2 USD H	1.91%	-5.57%	-11.12%	-0.60%
WA	0.17%	-8.27%	-12.51%	-6.63%
WA HKD H	1.45%	-6.41%	-11.56%	-1.57%
WA USD H	1.99%	-5.53%	-11.12%	-0.58%
WT	0.23%	-8.19%	-12.51%	-6.55%
WT SGD H	1.43%	-6.19%	-11.26%	-2.06%
WT USD H	1.96%	-5.62%	-11.21%	-0.62%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Emerging Markets Debt Portfolio				
Klasse				
A	1.93%	-9.87%	-23.30%	87.54%
A EUR	-3.22%	-4.48%	-9.90%	112.24%
A2	1.91%	-9.88%	-23.35%	88.40%
A2 CHF H	-0.32%	-13.04%	-24.79%	-17.73%
A2 EUR	-3.19%	-4.47%	-9.95%	113.34%
A2 EUR H	0.00%	-12.74%	-24.79%	11.87%
A2 HKD	1.92%	-9.49%	-22.66%	42.46%
A2 PLN	-3.54%	-4.51%	-5.95%	-6.95%
A2 PLN H	3.63%	-7.24%	-22.30%	-11.35%
A2 SGD H	1.33%	-10.65%	-23.59%	16.87%
AA	1.86%	-9.91%	-23.34%	8.65%
AA AUD H	0.52%	-11.84%	-24.06%	5.66%
AA CAD H	1.47%	-10.64%	-23.65%	-3.89%
AA EUR H	0.01%	-12.76%	-24.80%	-13.85%
AA GBP H	0.59%	-11.67%	-23.97%	-8.34%
AA HKD	1.92%	-9.49%	-22.66%	4.01%
AA NZD H	0.70%	-11.49%	-23.66%	2.31%
AA RMB H	0.34%	-10.97%	-22.09%	19.64%
AA SGD H	1.37%	-10.64%	-23.59%	2.73%
AA ZAR H	2.74%	-7.68%	-20.15%	58.45%
AI	1.90%	-9.88%	-23.37%	-18.51%
AI AUD H	0.56%	-11.88%	-24.12%	-20.54%
AR EUR	-3.22%	-4.47%	-9.84%	11.56%
AT	1.85%	-9.88%	-23.31%	88.25%
AT AUD H	0.54%	-11.89%	-24.11%	43.60%
AT CAD H	1.42%	-10.62%	-23.63%	-2.74%
AT EUR	-3.20%	-4.45%	-9.92%	108.04%
AT EUR H	-0.03%	-12.81%	-24.84%	12.04%
AT GBP H	0.70%	-11.63%	-23.96%	-7.29%
AT HKD	1.91%	-9.49%	-22.65%	42.46%
AT NZD H	0.65%	-11.47%	-23.64%	7.76%
AT SGD H	1.24%	-10.72%	-23.56%	16.71%
BT	1.42%	-10.73%	-24.08%	59.00%
C	1.71%	-10.25%	-23.69%	73.98%
C EUR	-3.29%	-4.79%	-10.33%	97.12%
C2	1.67%	-10.29%	-23.70%	74.40%
C2 EUR	-3.40%	-4.88%	-10.33%	97.52%
C2 EUR H	-0.25%	-13.11%	-25.13%	6.00%
CT	1.70%	-10.27%	-23.69%	-1.91%
EA	1.60%	-10.36%	-23.71%	-16.15%
EA AUD H	0.32%	-12.33%	-24.46%	-20.99%
EA ZAR H	2.51%	-8.12%	-20.55%	-6.54%
EI	1.66%	-10.33%	-23.73%	-19.32%
EI AUD H	0.30%	-12.34%	-24.50%	-21.34%
I	2.23%	-9.38%	-22.93%	105.70%
I2	2.18%	-9.41%	-22.94%	106.60%
I2 AUD H	0.86%	-6.27%(4)	-	-6.27%
I2 CHF H	0.00%	-12.53%	-24.38%	-12.93%
I2 EUR	-2.91%	-3.97%	-9.45%	134.02%
I2 EUR H	0.28%	-12.28%	-24.37%	20.53%
IT AUD H	0.92%	-11.35%	-23.73%	6.99%
IT EUR H	0.26%	-12.34%	-24.42%	-10.24%
N2	1.62%	-10.35%	-23.77%	-3.53%
NT	1.58%	-10.46%	-23.76%	-3.57%
S	2.56%	-8.74%	-22.41%	47.56%
S1 2	2.27%	-9.26%	-22.84%	92.13%
S1 2EUR	-2.82%	-3.74%	-9.28%	156.06%
S1 EUR H	0.34%	-12.14%	-24.26%	16.73%
S1 GBP H	1.02%	-10.95%	-23.36%	25.73%
SA	2.54%	-8.76%	-22.41%	19.26%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Mortgage Income Portfolio				
Klasse				
A	2.45%	0.73%	-2.66%	21.36%
A2	2.52%	0.77%	-2.73%	21.87%
A2 EUR	-2.59%	6.86%	14.30%	58.10%
A2 HKD	2.51%	1.20%	-1.83%	7.92%
A2 SGD	-1.08%	0.24%	1.09%	30.12%
A2X	2.50%	0.85%	-2.67%	37.75%
A2X EUR	-2.52%	6.90%	14.30%	15.15%
AA	2.48%	0.75%	-2.78%	21.78%
AA AUD H	1.74%	-0.40%	-3.25%	22.22%
AA HKD	2.51%	1.21%	-1.85%	20.54%
AA RMB H	1.32%	0.17%	-0.93%	33.20%
AA SGD H	2.16%	0.28%	-2.80%	18.71%
AA ZAR H	3.98%	4.35%	1.90%	88.49%
AR EUR H	0.93%	-1.75%	-4.00%	1.11%
AT	2.47%	0.77%	-2.71%	21.69%
AT AUD H	1.78%	-0.36%	-3.25%	22.34%
AT EUR	-2.65%	6.78%	14.29%	57.84%
AT GBP H	1.74%	-0.26%	-3.09%	-1.78%
AT HKD	2.51%	1.21%	-1.85%	7.81%
AT SGD	-1.09%	0.25%	1.13%	30.04%
AT SGD H	2.26%	0.42%	-2.89%	18.56%
AX	2.56%	0.73%	-2.67%	78.40%
AX EUR	-2.53%	7.10%	14.38%	38.67%
BX	2.32%	0.26%	-3.12%	56.75%
BX EUR	-2.76%	6.43%	13.69%	-0.65%
C	2.31%	0.35%	-3.19%	16.61%
C2	2.28%	0.29%	-3.17%	16.80%
C2 EUR	-2.82%	6.35%	13.82%	51.60%
CX	2.32%	0.26%	-3.12%	56.62%
I	2.74%	1.32%	-2.18%	27.72%
I EUR	-2.29%	7.38%	14.83%	65.48%
I2	2.78%	1.32%	-2.20%	28.00%
I2 EUR	-2.31%	7.46%	14.97%	66.15%
I2 EUR H	1.25%	-1.22%	-3.55%	-2.80%
IT EUR H	1.32%	-1.24%	-3.67%	-3.44%
IX	2.85%	1.32%	-2.11%	75.59%
N2	2.28%	0.26%	-3.31%	1.67%
NT	2.24%	0.19%	-3.33%	1.71%
S	3.12%	2.07%	-1.48%	36.60%
S1	2.87%	1.47%	-2.03%	30.52%
S1 AUD H	4.12%(1)	–	–	4.12%
S1 EUR	-2.25%	7.63%	15.16%	69.08%
S1 EUR H	1.38%	-1.08%	-3.47%	-4.54%
S1 JPY	0.81%	20.20%	23.73%	28.36%
SA	3.13%	2.00%	-1.56%	33.45%

Die Wertentwicklung der Anteilsklassen der einzelnen Portefeuilles basiert auf dem Nettoinventarwert zum 28. Februar 2023, wobei die Auswirkungen der von der Verwaltungsgesellschaft rückerstatteten bzw. erlassenen Aufwendungen einberechnet wurden. Verkaufsgebühren, die beim Kauf oder bei der Rücknahme von Anteilen erhoben werden können, wurden nicht berücksichtigt. Die Wertentwicklung der ausschüttenden Anteilsklassen umfasst die während des Berichtszeitraums ausgeschütteten und wieder angelegten Beträge. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist keine Garantie für aktuelle oder zukünftige Ergebnisse. Die Wertentwicklungszahlen berücksichtigen nicht die Provisionen und Kosten im Zusammenhang mit der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen. Anlagerenditen und der Wert des angelegten Kapitals unterliegen Schwankungen, so dass die Anteile eines Anlegers bei Rücknahme mehr oder weniger als die ursprünglichen Anschaffungskosten wert sein können.

* Sechsmonatszeitraum zum 28. Februar 2023

Rendite berechnet ab Auflegungsdatum am:

- (1) 7. Oktober 2022
- (2) 24. Juni 2022
- (3) 5. Oktober 2022
- (4) 2. Juni 2022

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Charter Communications, Inc. - Class A	275	\$ 101,093	0.3%
Comcast Corp. - Class A	4,303	159,943	0.4
Deutsche Telekom AG (REG)	2,820	63,289	0.2
Spark New Zealand Ltd.	8,980	27,726	0.1
		<u>352,051</u>	<u>1.0</u>
UNTERHALTUNG			
Activision Blizzard, Inc.	578	44,072	0.1
Electronic Arts, Inc.	1,441	159,865	0.4
Live Nation Entertainment, Inc.	398	28,680	0.1
Universal Music Group NV	2,285	53,838	0.2
Walt Disney Co. (The)	910	90,645	0.3
		<u>377,100</u>	<u>1.1</u>
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class A	552	49,713	0.1
Alphabet, Inc. - Class C	2,313	208,864	0.6
Meta Platforms, Inc. - Class A	41	7,173	0.0
Tencent Holdings Ltd.	2,370	104,110	0.4
		<u>369,860</u>	<u>1.1</u>
		<u>1,099,011</u>	<u>3.2</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Aisin Corp.	400	10,962	0.1
Aptiv PLC	1,257	146,164	0.4
BorgWarner, Inc.	683	34,341	0.1
Faurecia SE	2,010	43,840	0.1
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	2,970	33,739	0.1
		<u>269,046</u>	<u>0.8</u>
KRAFTFAHRZEUGE			
Stellantis NV	4,095	71,373	0.2
Tesla, Inc.	232	47,725	0.1
		<u>119,098</u>	<u>0.3</u>
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
ADT, Inc.	7,439	56,090	0.2
Service Corp. International/US	658	44,435	0.1
		<u>100,525</u>	<u>0.3</u>
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Aramark	685	25,208	0.1
Caesars Entertainment, Inc.	261	13,248	0.0
Compass Group PLC	10,067	232,566	0.7
Entain PLC	3,680	60,097	0.2
Evolution AB	147	17,738	0.1
Expedia Group, Inc.	218	23,756	0.1
Galaxy Entertainment Group Ltd.	8,450	56,257	0.1
Hyatt Hotels Corp. - Class A	580	67,419	0.2
La Francaise des Jeux SAEM	341	13,460	0.0
Marriott International, Inc./MD - Class A	198	33,510	0.1
Sodexo SA	306	28,341	0.1
Starbucks Corp.	1,080	110,257	0.3
Tongcheng Travel Holdings Ltd.	16,700	33,149	0.1
Yum China Holdings, Inc.	1,067	62,665	0.2
		<u>777,671</u>	<u>2.3</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Midea Group Co., Ltd. - Class A	4,800	36,181	0.1
PulteGroup, Inc.	1,480	80,912	0.2
		<u>117,093</u>	<u>0.3</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd.	3,800	41,767	0.1
Alibaba Group Holding Ltd. (Sponsored ADR)	656	57,590	0.2
Amazon.com, Inc.	3,243	305,588	0.9
Prosus NV	397	28,461	0.1
		<u>433,406</u>	<u>1.3</u>
FREIZEITPRODUKTE			
BRP, Inc.	325	28,160	0.1

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
MEDIEN			
Liberty Global PLC - Class A	931	\$ 19,076	0.1%
MULTILINE-EINZELHANDEL			
Cie Financiere Richemont SA (REG)	244	36,868	0.1
Dollarama, Inc.	105	6,065	0.0
		<u>42,933</u>	<u>0.1</u>
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Bath & Body Works, Inc.	676	27,628	0.1
Best Buy Co., Inc.	343	28,507	0.1
Home Depot, Inc. (The)	171	50,708	0.1
O'Reilly Automotive, Inc.	40	33,204	0.1
TJX Cos., Inc. (The)	1,239	94,908	0.3
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	6,100	30,471	0.1
		<u>265,426</u>	<u>0.8</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Carter's, Inc.	785	59,181	0.2
Kering SA	99	58,046	0.1
NIKE, Inc. - Class B	1,452	172,483	0.5
Pandora A/S	367	34,763	0.1
Tapestry, Inc.	1,460	63,525	0.2
		<u>387,998</u>	<u>1.1</u>
		<u>2,560,432</u>	<u>7.5</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Asahi Group Holdings Ltd.	4,960	175,407	0.5
Coca-Cola Co. (The)	4,220	251,132	0.8
Constellation Brands, Inc. - Class A	665	148,761	0.4
Heineken Holding NV	256	21,901	0.1
		<u>597,201</u>	<u>1.8</u>
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Atacadao SA	13,400	34,425	0.1
George Weston Ltd.	231	28,940	0.1
Sysco Corp.	126	9,396	0.0
		<u>72,761</u>	<u>0.2</u>
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Archer-Daniels-Midland Co.	399	31,760	0.1
Bunge Ltd.	321	30,656	0.1
Hain Celestial Group, Inc. (The)	2,230	39,761	0.1
Hershey Co. (The)	114	27,169	0.1
Lamb Weston Holdings, Inc.	316	31,802	0.1
Nestle SA	1,547	174,301	0.5
Nomad Foods Ltd.	2,080	37,274	0.1
Salmar ASA	615	25,495	0.1
		<u>398,218</u>	<u>1.2</u>
HAUSHALTSPRODUKTE			
Colgate-Palmolive Co.	461	33,791	0.1
Kimberly-Clark Corp.	60	7,503	0.0
Procter & Gamble Co. (The)	48	6,603	0.0
		<u>47,897</u>	<u>0.1</u>
TABAK			
Imperial Brands PLC	1,239	29,849	0.1
		<u>1,145,926</u>	<u>3.4</u>
ENERGIE			
ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE			
Baker Hughes Co.	1,590	48,654	0.1
Halliburton Co.	551	19,962	0.1
		<u>68,616</u>	<u>0.2</u>
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
Cameco Corp.	1,930	52,766	0.1
Cenovus Energy, Inc.	1,564	28,839	0.1
Cheniere Energy, Inc.	497	78,198	0.2
Chevron Corp.	40	6,431	0.0
Equinor ASA	1,090	33,369	0.1
Exxon Mobil Corp.	178	19,564	0.1
HF Sinclair Corp.	531	26,401	0.1
Imperial Oil Ltd.	534	26,412	0.1
Marathon Petroleum Corp.	276	34,114	0.1
Repsol SA	1,938	30,649	0.1
Shell PLC	9,568	290,272	0.8

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Texas Pacific Land Corp.	14	\$ 24,923	0.1%
Tourmaline Oil Corp.	79	3,462	0.0
		<u>655,400</u>	<u>1.9</u>
		<u>724,016</u>	<u>2.1</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
ABN AMRO Bank NV (GDR)	2,997	52,885	0.1
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	4,898	38,072	0.1
Bank Leumi Le-Israel BM	4,210	32,731	0.1
Bank of Ireland Group PLC	5,230	57,619	0.2
BNP Paribas SA	1,284	89,766	0.3
Citigroup, Inc.	862	43,695	0.1
Comerica, Inc.	810	56,781	0.2
Commerzbank AG	1,975	24,066	0.1
Commonwealth Bank of Australia	540	36,482	0.1
First Citizens BancShares, Inc./NC - Class A	76	55,766	0.2
HDFC Bank Ltd. (ADR)	2,334	157,872	0.5
JPMorgan Chase & Co.	319	45,729	0.1
KB Financial Group, Inc.	1,350	52,284	0.1
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	9,550	67,705	0.2
NatWest Group PLC	19,766	69,437	0.2
Resona Holdings, Inc.	11,700	64,442	0.2
Skandinaviska Enskilda Banken AB - Class A	2,121	26,537	0.1
Societe Generale SA	1,164	33,546	0.1
Standard Chartered PLC	3,645	34,490	0.1
Swedbank AB - Class A	473	9,664	0.0
Wells Fargo & Co.	4,083	190,962	0.5
		<u>1,240,531</u>	<u>3.6</u>
KAPITALMÄRKTE			
Ameriprise Financial, Inc.	100	34,287	0.1
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	18,400	37,078	0.1
BlackRock, Inc.	55	37,919	0.1
Charles Schwab Corp. (The)	3,370	262,590	0.8
CME Group, Inc.	366	67,842	0.2
Euronext NV	97	7,075	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	624	219,430	0.7
Julius Baer Group Ltd.	1,544	102,364	0.3
Morgan Stanley	255	24,607	0.1
Raymond James Financial, Inc.	89	9,653	0.0
		<u>802,845</u>	<u>2.4</u>
FINANZWESEN – VERBRAUCHER			
American Express Co.	423	73,598	0.2
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
Berkshire Hathaway, Inc. - Class B	44	13,428	0.1
Wendel SE	107	12,135	0.0
		<u>25,563</u>	<u>0.1</u>
VERSICHERUNGEN			
AIA Group Ltd.	16,200	172,174	0.5
American International Group, Inc.	542	33,122	0.1
Aviva PLC	5,502	29,559	0.1
Everest Re Group Ltd.	90	34,557	0.1
Fidelity National Financial, Inc.	205	8,171	0.0
Gjensidige Forsikring ASA	490	8,685	0.0
Japan Post Holdings Co., Ltd.	3,600	32,001	0.1
Japan Post Insurance Co., Ltd.	1,700	29,516	0.1
Manulife Financial Corp.	1,703	33,673	0.1
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	8,300	56,660	0.2
Principal Financial Group, Inc.	347	31,078	0.1
Prudential Financial, Inc.	291	29,100	0.1
Willis Towers Watson PLC	182	42,654	0.1
		<u>540,950</u>	<u>1.6</u>
		<u>2,683,487</u>	<u>7.9</u>
GESUNDHEITSWESEN			
BIOTECHNOLOGIE			
AbbVie, Inc.	299	46,016	0.1
Amgen, Inc.	70	16,216	0.1
Genmab A/S	364	136,954	0.4
Gilead Sciences, Inc.	352	28,347	0.1
Neurocrine Biosciences, Inc.	106	10,929	0.0
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	23	6,677	0.0
		<u>245,139</u>	<u>0.7</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Abbott Laboratories	1,440	\$ 146,477	0.4%
Coloplast A/S - Class B	262	30,273	0.1
Dexcom, Inc.	126	13,987	0.1
IDEXX Laboratories, Inc.	23	10,884	0.0
Insulet Corp.	35	9,673	0.0
Koninklijke Philips NV	2,573	42,009	0.1
Medtronic PLC	2,127	176,115	0.5
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	787	97,486	0.3
		<u>526,904</u>	<u>1.5</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
AmerisourceBergen Corp.	196	30,490	0.1
Cardinal Health, Inc.	269	20,366	0.1
Centene Corp.	1,207	82,559	0.2
Elevance Health, Inc.	363	170,490	0.5
Humana, Inc.	66	32,671	0.1
McKesson Corp.	90	31,483	0.1
Molina Healthcare, Inc.	55	15,143	0.1
UnitedHealth Group, Inc.	28	13,326	0.0
		<u>396,528</u>	<u>1.2</u>
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Agilent Technologies, Inc.	218	30,949	0.1
Illumina, Inc.	483	96,214	0.3
IQVIA Holdings, Inc.	710	148,014	0.4
Lonza Group AG	256	152,484	0.5
Mettler-Toledo International, Inc.	5	7,169	0.0
Thermo Fisher Scientific, Inc.	173	93,724	0.3
Waters Corp.	94	29,224	0.1
WuXi AppTec Co., Ltd. Class H	1,000	10,669	0.0
		<u>568,447</u>	<u>1.7</u>
PHARMAZEUTIKA			
Eli Lilly & Co.	160	49,795	0.2
Jazz Pharmaceuticals PLC	25	3,510	0.0
Johnson & Johnson	98	15,020	0.0
Merck & Co., Inc.	16	1,700	0.0
Novo Nordisk A/S - Class B	1,374	194,085	0.6
Pfizer, Inc.	1,083	43,937	0.1
Roche Holding AG (BR)	46	14,250	0.0
Roche Holding AG (Genusschein)	709	204,432	0.6
Sanofi	2,310	215,981	0.6
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	1,640	50,552	0.2
Zoetis, Inc.	815	136,105	0.4
		<u>929,367</u>	<u>2.7</u>
		<u>2,666,385</u>	<u>7.8</u>
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
Airbus SE	763	99,931	0.3
BAE Systems PLC	3,128	33,783	0.1
Dassault Aviation SA	70	12,034	0.0
Huntington Ingalls Industries, Inc.	141	30,343	0.1
Kongsberg Gruppen ASA	654	27,177	0.1
Spirit AeroSystems Holdings, Inc. - Class A	1,200	41,016	0.1
		<u>244,284</u>	<u>0.7</u>
LUFTFRACHT UND LOGISTIK			
Expeditors International of Washington, Inc.	278	29,068	0.1
FLUGGESELLSCHAFTEN			
Deutsche Lufthansa AG (REG)	2,890	29,943	0.1
Qantas Airways Ltd.	3,892	16,739	0.0
		<u>46,682</u>	<u>0.1</u>
BAUPRODUKTE			
Otis Worldwide Corp.	2,294	194,118	0.6
Owens Corning	315	30,804	0.1
		<u>224,922</u>	<u>0.7</u>
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Cintas Corp.	26	11,400	0.0
BAU- UND INGENIEURWESEN			
Dycom Industries, Inc.	770	64,842	0.2
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Eaton Corp. PLC	945	165,309	0.5
Hubbell, Inc.	45	11,319	0.0

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Vertiv Holdings Co.	2,540	\$ 41,275	0.1%
		<u>217,903</u>	<u>0.6</u>
MASCHINEN			
Alstom SA	7,012	205,790	0.6
Amada Co., Ltd.	8,800	80,081	0.2
Atlas Copco AB - Class B	1,046	11,019	0.0
Caterpillar, Inc.	117	28,027	0.1
CNH Industrial NV	1,815	29,752	0.1
Cummins, Inc.	24	5,834	0.0
Dover Corp.	344	51,566	0.2
Illinois Tool Works, Inc.	160	37,306	0.1
PACCAR, Inc.	450	32,490	0.1
Parker-Hannifin Corp.	207	72,833	0.2
Snap-on, Inc.	130	32,328	0.1
Volvo AB - Class A	467	9,722	0.0
Volvo AB - Class B	4,071	81,457	0.3
		<u>678,205</u>	<u>2.0</u>
SCHIFFFAHRT			
SITC International Holdings Co., Ltd.	6,000	12,551	0.1
Star Bulk Carriers Corp.	1,880	46,079	0.1
		<u>58,630</u>	<u>0.2</u>
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Booz Allen Hamilton Holding Corp.	97	9,189	0.0
Randstad NV	105	6,443	0.0
Recruit Holdings Co., Ltd.	3,410	91,442	0.3
RELX PLC (Amsterdam)	525	15,843	0.1
RELX PLC (London)	1,338	40,348	0.1
Robert Half International, Inc.	1,193	96,180	0.3
		<u>259,445</u>	<u>0.8</u>
STRASSE UND SCHIENE			
CSX Corp.	1,663	50,705	0.2
XPO, Inc.	1,100	36,696	0.1
		<u>87,401</u>	<u>0.3</u>
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
Ashtead Group PLC	2,328	154,042	0.5
Fastenal Co.	653	33,669	0.1
Toyota Tsusho Corp.	300	12,235	0.0
United Rentals, Inc.	83	38,888	0.1
WW Grainger, Inc.	55	36,764	0.1
		<u>275,598</u>	<u>0.8</u>
		<u>2,198,380</u>	<u>6.5</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONS-AUSRÜSTUNG			
Juniper Networks, Inc.	958	29,487	0.1
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
CDW Corp./DE	167	33,804	0.1
Ibiden Co., Ltd.	200	6,860	0.0
Murata Manufacturing Co., Ltd.	1,830	97,955	0.3
		<u>138,619</u>	<u>0.4</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Akamai Technologies, Inc.	973	70,640	0.2
Automatic Data Processing, Inc.	1,225	269,279	0.8
BIPROGY, Inc.	1,800	39,887	0.1
Capgemini SE	399	74,827	0.2
CGI, Inc.	35	3,138	0.0
Cognizant Technology Solutions Corp. - Class A	1,881	117,807	0.3
Gartner, Inc.	98	32,125	0.1
Mastercard, Inc. - Class A	931	330,775	1.0
PayPal Holdings, Inc.	1,175	86,480	0.3
VeriSign, Inc.	82	16,140	0.0
Visa, Inc. - Class A	1,291	283,943	0.9
		<u>1,325,041</u>	<u>3.9</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Applied Materials, Inc.	733	85,138	0.3
ASML Holding NV	246	151,624	0.4
Enphase Energy, Inc.	112	23,579	0.1
Infineon Technologies AG	1,447	51,190	0.2
KLA Corp.	83	31,489	0.1
Lam Research Corp.	73	35,479	0.1
Microchip Technology, Inc.	64	5,186	0.0

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
NVIDIA Corp.	105	\$ 24,377	0.1%
NXP Semiconductors NV	230	41,050	0.1
QUALCOMM, Inc.	665	82,147	0.2
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	4,810	79,576	0.2
Teradyne, Inc.	301	30,443	0.1
		<u>641,278</u>	<u>1.9</u>
SOFTWARE			
ACI Worldwide, Inc.	1,670	43,170	0.1
Autodesk, Inc.	167	33,181	0.1
Cadence Design Systems, Inc.	189	36,466	0.1
CommVault Systems, Inc.	906	53,345	0.2
CyberArk Software Ltd.	219	31,705	0.1
Dropbox, Inc. - Class A	1,305	26,622	0.1
Fortinet, Inc.	544	32,335	0.1
Gen Digital, Inc.	2,470	48,190	0.2
Intuit, Inc.	26	10,587	0.0
Microsoft Corp.	2,910	725,812	2.1
Oracle Corp.	1,190	104,006	0.3
Sage Group PLC (The)	3,182	28,670	0.1
SAP SE	1,118	127,017	0.4
Workday, Inc. - Class A	188	34,868	0.1
Zoom Video Communications, Inc. - Class A	110	8,205	0.0
		<u>1,344,179</u>	<u>4.0</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	1,495	220,378	0.6
NetApp, Inc.	119	7,681	0.0
Ricoh Co., Ltd.	3,800	29,522	0.1
Samsung Electronics Co., Ltd.	3,788	173,320	0.5
Western Digital Corp.	1,460	56,181	0.2
		<u>487,082</u>	<u>1.4</u>
		<u>3,965,686</u>	<u>11.7</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Linde PLC	322	112,175	0.3
LyondellBasell Industries NV - Class A	850	81,591	0.2
Mitsubishi Chemical Holdings Corp.	1,800	10,485	0.0
OCI NV	899	29,863	0.1
Sika AG	419	117,498	0.4
Sumitomo Chemical Co., Ltd.	7,700	26,981	0.1
		<u>378,593</u>	<u>1.1</u>
METALL UND BERGBAU			
Antofagasta PLC	1,375	25,938	0.1
ArcelorMittal SA	2,120	63,620	0.2
BHP Group Ltd.	1,323	40,041	0.1
Endeavour Mining PLC	1,798	36,674	0.1
Fortescue Metals Group Ltd.	2,016	28,889	0.1
Mineral Resources Ltd.	277	15,298	0.0
Rio Tinto Ltd.	80	6,252	0.0
Steel Dynamics, Inc.	291	36,698	0.1
Teck Resources Ltd. - Class B	522	20,838	0.1
		<u>274,248</u>	<u>0.8</u>
STEEL			
ATI, Inc.	1,230	49,999	0.2
		<u>702,840</u>	<u>2.1</u>
IMMOBILIEN			
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)			
American Tower Corp.	767	151,873	0.4
Americold Realty Trust, Inc.	2,070	60,858	0.2
Stockland	3,512	9,047	0.0
Weyerhaeuser Co.	956	29,875	0.1
		<u>251,653</u>	<u>0.7</u>
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG			
CBRE Group, Inc. - Class A	1,333	113,492	0.3
Swire Pacific Ltd. - Class A	3,000	24,482	0.1
		<u>137,974</u>	<u>0.4</u>
IMMOBILIEN-DIENSTLEISTUNGEN			
Open House Group Co., Ltd.	800	28,794	0.1
REITs – EINZELHANDEL			
Simon Property Group, Inc.	267	32,598	0.1
		<u>451,019</u>	<u>1.3</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %	
SOFTWARE UND DIENSTLEISTUNGEN						
IT-BERATUNG UND ANDERE DIENSTLEISTUNGEN						
Kyndryl Holdings, Inc.			58	\$ 910	0.0%	
VERSORGUNG						
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE						
EDP - Energias de Portugal SA			16,691	84,051	0.2	
Enel SpA			16,450	92,277	0.3	
Iberdrola SA			4,395	50,382	0.1	
NRG Energy, Inc.			917	30,069	0.1	
				<u>256,779</u>	<u>0.7</u>	
GASVERSORGUNGSBETRIEBE						
China Resources Gas Group Ltd.			7,900	33,336	0.1	
Kunlun Energy Co., Ltd.			54,000	43,267	0.1	
Naturgy Energy Group SA			703	19,339	0.1	
UGI Corp.			783	29,151	0.1	
				<u>125,093</u>	<u>0.4</u>	
MEHRFACH-VERSORGUNGSBETRIEBE						
NiSource, Inc.			1,113	30,529	0.1	
				<u>412,401</u>	<u>1.2</u>	
				<u>18,610,493</u>	<u>54.7</u>	
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE						
AUSTRALIEN						
Australia Government Bond, Series 144	3.75%	04/21/2037	AUD	60	38,907	0.1
ÖSTERREICH						
Republic of Austria Government Bond	0.00%	02/20/2030	EUR	53	45,126	0.1
Republic of Austria Government Bond	0.00%	02/20/2031		120	98,938	0.3
Republic of Austria Government Bond	0.90%	02/20/2032		246	213,934	0.6
				<u>357,998</u>	<u>1.0</u>	
BELGIEN						
Kingdom of Belgium Government Bond, Series 84	1.45%	06/22/2037		63	51,607	0.2
Kingdom of Belgium Government Bond, Series 96	2.75%	04/22/2039		73	69,805	0.2
				<u>121,412</u>	<u>0.4</u>	
KANADA						
Canadian Government Bond	2.25%	12/01/2029	CAD	40	27,403	0.1
Canadian Government Bond	2.75%	09/01/2027		260	184,474	0.5
				<u>211,877</u>	<u>0.6</u>	
FINNLAND						
Finland Government Bond	0.00%	09/15/2030	EUR	44	36,876	0.1
DEUTSCHLAND						
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.00%	08/15/2050		76	40,477	0.1
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1.70%	08/15/2032		240	234,859	0.7
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1.80%	08/15/2053		12	10,878	0.1
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	3.25%	07/04/2042		8	9,467	0.0
				<u>295,681</u>	<u>0.9</u>	
INDONESIEN						
Indonesia Treasury Bond, Series FR87	6.50%	02/15/2031	IDR	986,000	63,583	0.2
IRLAND						
Ireland Government Bond	3.00%	10/18/2043	EUR	46	46,207	0.1
ITALIEN						
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series 10Y	4.40%	05/01/2033		48	50,670	0.2
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series 13Y	4.00%	04/30/2035		40	40,228	0.1
				<u>90,898</u>	<u>0.3</u>	
JAPAN						
Japan Government Five Year Bond, Series 138	0.10%	12/20/2023	JPY	64,800	476,605	1.4
Japan Government Ten Year Bond, Series 332	0.60%	12/20/2023		37,900	279,868	0.8
Japan Government Thirty Year Bond, Series 65	0.40%	12/20/2049		11,350	65,366	0.2
Japan Government Thirty Year Bond, Series 68	0.60%	09/20/2050		11,950	72,177	0.2
Japan Government Thirty Year Bond, Series 74	1.00%	03/20/2052		1,950	13,048	0.0
Japan Government Twenty Year Bond, Series 171	0.30%	12/20/2039		7,850	50,770	0.2
Japan Government Twenty Year Bond, Series 183	1.40%	12/20/2042		23,950	182,083	0.5
Japan Government Two Year Bond, Series 430	0.01%	11/01/2023		32,200	236,641	0.7
Japan Government Two Year Bond, Series 432	0.01%	01/01/2024		28,900	212,396	0.6
Japan Government Two Year Bond, Series 433	0.01%	02/01/2024		8,650	63,595	0.2
Japan Government Two Year Bond, Series 437	0.01%	06/01/2024		18,250	134,144	0.4
				<u>1,786,693</u>	<u>5.2</u>	
MALAYSIA						
Malaysia Government Bond, Series 310	4.50%	04/15/2030	MYR	245	56,862	0.2

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
MEXIKO						
	Mexican Bonos	5.50%	03/04/2027	MXN	5,482 \$	255,526 0.8%
	Mexican Bonos, Series M	5.75%	03/05/2026		3,405	164,057 0.5
	Mexican Bonos, Series M 20	8.50%	05/31/2029		860	44,855 0.1
						<u>464,438</u> 1.4
NEUSEELAND						
	New Zealand Government Bond, Series 433	3.50%	04/14/2033	NZD	201	113,527 0.3
	New Zealand Government Bond, Series 532	2.00%	05/15/2032		104	52,018 0.2
						<u>165,545</u> 0.5
PERU						
	Peru Government Bond	6.15%	08/12/2032	PEN	438	101,511 0.3
SPANIEN						
	Spain Government Bond	3.45%	07/30/2043	EUR	103	100,411 0.3
	Spain Government Bond	3.90%	07/30/2039		117	122,520 0.4
						<u>222,931</u> 0.7
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
	United Kingdom Gilt	0.88%	01/31/2046	GBP	151	94,064 0.3
	United Kingdom Gilt	1.25%	10/22/2041		40	30,166 0.1
	United Kingdom Gilt	1.25%	07/31/2051		11	6,638 0.0
	United Kingdom Gilt	1.50%	07/31/2053		66	43,999 0.1
	United Kingdom Gilt	1.75%	09/07/2037		39	35,162 0.1
	United Kingdom Gilt	3.75%	01/29/2038		27	30,653 0.1
						<u>240,682</u> 0.7
VEREINIGTE STAATEN						
	U.S. Treasury Bonds	1.13%	08/15/2040	USD	537	337,051 1.0
	U.S. Treasury Bonds	1.25%	05/15/2050		284	156,555 0.5
	U.S. Treasury Bonds	1.75%	08/15/2041		47	32,459 0.1
	U.S. Treasury Bonds	2.00%	08/15/2051		190	126,736 0.4
	U.S. Treasury Bonds	2.38%	02/15/2042		95	72,898 0.2
	U.S. Treasury Notes	0.25%	05/31/2025		113	102,245 0.3
	U.S. Treasury Notes	0.38%	07/15/2024		6	5,533 0.0
	U.S. Treasury Notes	0.50%	11/30/2023		75	72,469 0.2
	U.S. Treasury Notes	0.75%	11/15/2024		110	102,489 0.3
	U.S. Treasury Notes	1.25%	11/30/2026		265	236,678 0.7
	U.S. Treasury Notes	1.50%	01/31/2027		119	106,663 0.3
	U.S. Treasury Notes	2.13%	05/31/2026		180	167,484 0.5
	U.S. Treasury Notes	2.25%	02/15/2027		719	665,557 1.9
	U.S. Treasury Notes	2.88%	05/15/2032		94	86,392 0.2
	U.S. Treasury Notes	3.50%	01/31/2028		64	62,050 0.2
	U.S. Treasury Notes	4.13%	11/15/2032		189	192,271 0.6
						<u>2,525,530</u> 7.4
						<u>6,827,631</u> 20.1
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT						
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
	Banco de Credito del Peru S.A.	3.13%	07/01/2030		40	36,245 0.1
	Banco Santander SA	1.13%	06/23/2027	EUR	100	93,401 0.3
	Bank of America Corp.	2.88%	10/22/2030	USD	6	5,083 0.0
	Bank of America Corp.	3.19%	07/23/2030		6	5,209 0.0
	Bank of America Corp.	3.55%	04/23/2027		45	42,301 0.1
	Bank of America Corp.	3.97%	02/07/2030		6	5,491 0.0
	Citigroup, Inc.	3.98%	03/20/2030		45	41,071 0.1
	Citigroup, Inc.	4.08%	04/23/2029		27	25,132 0.1
	Cooperatieve Rabobank UA, Series G	4.63%	01/27/2028	EUR	100	106,644 0.3
	Credit Suisse AG/London	0.25%	01/05/2026		100	91,408 0.3
	Danske Bank A/S	0.75%	06/09/2029		100	86,487 0.2
	Discover Financial Services	6.70%	11/29/2032	USD	12	12,399 0.0
	Goldman Sachs Group, Inc. (The)	1.54%	09/10/2027		48	41,676 0.1
	Goldman Sachs Group, Inc. (The)	2.60%	02/07/2030		28	23,548 0.1
	Goldman Sachs Group, Inc. (The)	3.61%	03/15/2028		5	4,643 0.0
	HSBC Holdings PLC	5.21%	08/11/2028		200	195,436 0.6
	JPMorgan Chase & Co.	4.57%	06/14/2030		47	44,623 0.1
	JPMorgan Chase & Co.	4.85%	07/25/2028		24	23,457 0.1
	Morgan Stanley	0.40%	10/29/2027	EUR	100	91,415 0.3
	Santander Holdings USA, Inc.	2.49%	01/06/2028	USD	37	32,256 0.1
	US Bancorp, Series J(a)	5.30%	04/15/2027		27	24,520 0.1
						<u>1,032,445</u> 3.0
MAKLER						
	Charles Schwab Corp. (The)(b)	5.10%	05/13/2026		29	28,536 0.1
	Charles Schwab Corp. (The), Series I(a)	4.00%	06/01/2026		38	34,718 0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
SURA Asset Management SA	4.88%	04/17/2024	USD 100	\$ 98,331	0.3%
				<u>161,585</u>	<u>0.5</u>
FINANZEN					
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	22	21,518	0.1
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	9	7,945	0.0
Aviation Capital Group LLC	1.95%	09/20/2026	14	12,053	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	13	12,199	0.0
Synchrony Financial	2.88%	10/28/2031	27	20,321	0.1
Synchrony Financial	3.95%	12/01/2027	15	13,674	0.1
				<u>87,710</u>	<u>0.3</u>
VERSICHERUNGEN					
New York Life Global Funding(b)	4.85%	06/09/2026	22	21,363	0.1
Prudential Financial, Inc.	5.63%	06/15/2043	20	19,930	0.0
				<u>41,293</u>	<u>0.1</u>
REITs					
American Tower Corp.	0.88%	05/21/2029	EUR 100	84,594	0.3
Equinix, Inc.	2.63%	11/18/2024	USD 29	27,609	0.1
Essential Properties LP	2.95%	07/15/2031	38	28,329	0.1
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	3.25%	01/15/2032	15	11,905	0.0
Highwoods Realty LP	2.60%	02/01/2031	35	26,024	0.1
Host Hotels & Resorts LP, Series I	3.50%	09/15/2030	10	8,327	0.0
Omega Healthcare Investors, Inc.	3.25%	04/15/2033	19	13,625	0.0
Omega Healthcare Investors, Inc.	3.63%	10/01/2029	5	4,152	0.0
				<u>204,565</u>	<u>0.6</u>
				<u>1,527,598</u>	<u>4.5</u>
INDUSTRIE					
INVESTITIONSGÜTER					
Parker-Hannifin Corp.	4.50%	09/15/2029	36	34,393	0.1
Trane Technologies Financing Ltd.	5.25%	03/03/2033	7	6,943	0.0
				<u>41,336</u>	<u>0.1</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Charter Communications Operating LLC/ Charter Communications Operating Capital	5.38%	05/01/2047	20	15,869	0.1
Cox Communications, Inc.	1.80%	10/01/2030	37	28,502	0.1
Discovery Communications LLC	4.13%	05/15/2029	8	7,166	0.0
Discovery Communications LLC	4.65%	05/15/2050	9	6,576	0.0
Discovery Communications LLC	5.20%	09/20/2047	16	12,773	0.0
Meta Platforms, Inc.	4.65%	08/15/2062	17	14,138	0.0
Paramount Global	5.50%	05/15/2033	25	22,806	0.1
Thomson Reuters Corp.	5.50%	08/15/2035	26	25,297	0.1
Warnermedia Holdings, Inc.	3.76%	03/15/2027	11	10,092	0.0
				<u>143,219</u>	<u>0.4</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Bell Telephone Co. of Canada or Bell Canada (The)	3.00%	03/17/2031	CAD 5	3,168	0.0
Bell Telephone Co. of Canada or Bell Canada (The)	4.55%	02/09/2030	4	2,860	0.0
Bell Telephone Co. of Canada or Bell Canada (The)	5.15%	02/09/2053	9	6,315	0.0
Bell Telephone Co. of Canada or Bell Canada (The)	5.85%	11/10/2032	22	16,931	0.0
Corning, Inc.	5.45%	11/15/2079	USD 20	17,658	0.0
TELUS Corp.	5.25%	11/15/2032	CAD 27	19,784	0.1
Vodafone Group PLC	4.20%	12/13/2027	AUD 30	19,296	0.1
				<u>86,012</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.05%	02/14/2027	USD 31	27,804	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.35%	06/08/2025	11	10,494	0.0
Hyundai Capital America	1.80%	01/10/2028	20	16,767	0.1
Hyundai Capital America	2.10%	09/15/2028	14	11,615	0.0
Volkswagen Financial Services AG	0.88%	01/31/2028	EUR 41	36,529	0.1
				<u>103,209</u>	<u>0.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	USD 26	21,898	0.1
PulteGroup, Inc.	6.38%	05/15/2033	11	11,139	0.0
				<u>33,037</u>	<u>0.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
CK Hutchison Finance 16 II Ltd.	0.88%	10/03/2024	EUR 100	99,972	0.3
Ross Stores, Inc.	1.88%	04/15/2031	USD 35	27,349	0.1
				<u>127,321</u>	<u>0.4</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Altria Group, Inc.	3.13%	06/15/2031	EUR 100	88,326	0.3
Amgen, Inc.	4.40%	02/22/2062	USD 19	15,251	0.0
Sutter Health, Series 20A	2.29%	08/15/2030	27	22,286	0.1
				<u>125,863</u>	<u>0.4</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ENERGIE					
Continental Resources, Inc./OK	2.88%	04/01/2032	USD 23	\$ 17,403	0.1%
Continental Resources, Inc./OK	5.75%	01/15/2031	15	14,203	0.0
Enbridge Pipelines, Inc.	2.82%	05/12/2031	CAD 15	9,303	0.0
Enbridge, Inc.	6.10%	11/09/2032	14	10,819	0.0
Exxon Mobil Corp.	0.84%	06/26/2032	EUR 100	79,414	0.2
ONEOK, Inc.	6.10%	11/15/2032	USD 6	6,037	0.0
ONEOK, Inc.	6.35%	01/15/2031	20	20,482	0.1
Suncor Energy, Inc.	6.50%	06/15/2038	9	9,239	0.0
Suncor Energy, Inc.	6.85%	06/01/2039	15	16,052	0.1
TransCanada PipeLines Ltd.	5.33%	05/12/2032	CAD 27	19,664	0.1
Williams Cos., Inc. (The)	8.75%	03/15/2032	USD 22	26,129	0.1
				<u>228,745</u>	<u>0.7</u>
TECHNOLOGIE					
Fidelity National Information Services, Inc.	0.63%	12/03/2025	EUR 100	96,525	0.2
Honeywell International, Inc.	4.13%	11/02/2034	100	104,548	0.2
HP, Inc.	5.50%	01/15/2033	USD 30	28,321	0.1
Intel Corp.	5.05%	08/05/2062	22	19,243	0.1
Intel Corp.	5.90%	02/10/2063	21	20,668	0.1
Kyndryl Holdings, Inc.	2.05%	10/15/2026	23	19,778	0.1
QUALCOMM, Inc.	6.00%	05/20/2053	20	21,562	0.1
Western Digital Corp.	2.85%	02/01/2029	26	20,443	0.1
Western Digital Corp.	3.10%	02/01/2032	20	14,402	0.0
				<u>345,490</u>	<u>1.0</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Heathrow Funding Ltd.	6.45%	12/10/2031	GBP 50	63,024	0.2
				<u>1,297,256</u>	<u>3.8</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Cadent Finance PLC	0.63%	03/19/2030	EUR 100	81,954	0.2
E.ON International Finance BV	6.25%	06/03/2030	GBP 20	25,149	0.1
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	6.05%	03/01/2025	USD 8	8,053	0.0
				<u>115,156</u>	<u>0.3</u>
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE					
Anglian Water Services Financing PLC, Series A5	6.29%	07/30/2030	GBP 30	38,639	0.1
Thames Water Utilities Finance PLC	6.75%	11/16/2028	20	25,547	0.1
				<u>64,186</u>	<u>0.2</u>
				<u>179,342</u>	<u>0.5</u>
				<u>3,004,196</u>	<u>8.8</u>
GEDECKTE ANLEIHEN					
BPCE SFH SA	3.13%	01/24/2028	EUR 100	103,797	0.3
Caisse Francaise de Financement Local	3.13%	11/16/2027	100	104,008	0.3
Cie de Financement Foncier SA	0.01%	07/15/2026	100	93,889	0.2
DNB Boligkreditt AS	0.63%	06/19/2025	100	98,702	0.3
National Australia Bank Ltd.	2.25%	06/06/2025	100	102,164	0.3
National Westminster Bank PLC	0.50%	05/15/2024	100	101,784	0.3
Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj	2.63%	12/01/2025	100	103,126	0.3
Royal Bank of Canada	0.63%	03/23/2026	100	96,249	0.3
Stadshypotek AB	0.50%	07/11/2025	100	98,245	0.3
				<u>901,964</u>	<u>2.6</u>
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal National Mortgage Association, Series 2012	3.50%	02/01/2042	USD 5	4,440	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2012	3.50%	11/01/2042	50	46,534	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2012	3.50%	01/01/2043	8	7,801	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2013	3.50%	04/01/2043	28	26,456	0.1
Government National Mortgage Association, Series 2023	4.50%	03/01/2053	104	100,769	0.3
Government National Mortgage Association, Series 2023	5.00%	03/01/2053	210	207,565	0.6
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2023, TBA	3.00%	03/01/2053	102	89,561	0.3
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2023, TBA	3.50%	03/01/2053	147	133,685	0.4
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2023, TBA	4.50%	03/01/2053	196	188,850	0.6
				<u>805,661</u>	<u>2.4</u>
INFLATIONSgebundene Wertpapiere					
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Inflation Index	0.13%	07/15/2024	377	368,859	1.1
U.S. Treasury Inflation Index	0.13%	10/15/2026	454	428,309	1.2
				<u>797,168</u>	<u>2.3</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB SICAV I - Low Volatility Equity Portfolio - Class S1			17,858	688,422	2.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
FRANKREICH					
Dexia Credit Local SA	0.50%	01/17/2025	EUR 100	\$ 99,773	0.3%
DEUTSCHLAND					
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	3.20%	09/11/2026	AUD 24	15,584	0.0
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	4.10%	02/20/2026	100	66,995	0.2
				82,579	0.2
UNGARN					
Hungary Government International Bond	5.00%	02/22/2027	EUR 40	42,202	0.1
INDONESIEN					
Indonesia Government International Bond	1.00%	07/28/2029	100	85,727	0.3
MEXIKO					
Mexico Government International Bond	3.38%	02/23/2031	110	105,439	0.3
POLEN					
Republic of Poland Government International Bond	5.75%	11/16/2032	USD 29	30,348	0.1
RUMÄNIEN					
Romanian Government International Bond	6.63%	09/27/2029	EUR 30	32,088	0.1
				478,156	1.4
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2021-R01, Class 1M1(b)	5.23%	10/25/2041	USD 3	2,728	0.0
Series 2021-R01, Class 1M2(b)	6.03%	10/25/2041	10	10,059	0.0
Series 2021-R03, Class 1M1(b)	5.33%	12/25/2041	18	18,028	0.1
Series 2022-R01, Class 1M2(b)	6.38%	12/25/2041	100	96,362	0.3
Series 2022-R02, Class 2M1(b)	5.68%	01/25/2042	65	64,128	0.2
Eagle Re Ltd. Series 2018-1, Class M1 (b)			51,619	51,597	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2021-DNA3, Class M2(b)	6.58%	10/25/2033	17	16,880	0.1
Series 2021-DNA5, Class M2(b)	6.13%	01/25/2034	11	10,460	0.0
Series 2021-HQA4, Class M1(b)	5.43%	12/25/2041	29	28,009	0.1
Series 2022-DNA3, Class M1A(b)	6.48%	04/25/2042	81	81,358	0.2
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
Series 2014-C03, Class 2M2(b)	7.52%	07/25/2024	3	3,103	0.0
Series 2014-C04, Class 1M2(b)	9.52%	11/25/2024	17	17,428	0.1
Series 2014-C04, Class 2M2(b)	9.62%	11/25/2024	1	1,170	0.0
Series 2015-C04, Class 1M2(b)	10.31%	04/25/2028	6	6,611	0.0
Series 2016-C01, Class 1M2(b)	11.37%	08/25/2028	8	8,927	0.0
Series 2016-C03, Class 1M2(b)	9.92%	10/25/2028	13	13,576	0.0
				430,424	1.3
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN					
KANADA					
Export Development Canada	0.50%	02/25/2027	EUR 100	94,498	0.2
JAPAN					
Development Bank of Japan, Inc.	0.01%	10/15/2024	100	99,430	0.3
Development Bank of Japan, Inc.	2.30%	03/19/2026	JPY 30,000	233,781	0.7
				333,211	1.0
				427,709	1.2
SUPRANATIONALE UNTERNEHMEN					
European Investment Bank	0.75%	07/15/2027	AUD 51	29,438	0.1
European Investment Bank	1.80%	01/19/2027	45	27,527	0.1
Inter-American Development Bank	2.50%	04/14/2027	40	24,990	0.1
Inter-American Development Bank	4.25%	06/11/2026	34	22,871	0.1
International Bank for Reconstruction & Development	0.00%	01/15/2027	EUR 34	31,653	0.1
International Bank for Reconstruction & Development	3.00%	10/19/2026	AUD 20	12,861	0.0
International Bank for Reconstruction & Development, Series GDIF	0.01%	04/24/2028	EUR 46	41,124	0.1
International Finance Corp.	4.45%	05/14/2027	AUD 51	34,468	0.1
Nordic Investment Bank	4.75%	02/28/2024	60	40,614	0.1
				265,546	0.8
GEMEINDEVERWALTUNG – REGIONALANLEIHEN					
AUSTRALIEN					
New South Wales Treasury Corp.	2.00%	03/08/2033	281	149,571	0.4
JAPAN					
Japan Finance Organization for Municipalities, Series G	0.01%	02/02/2028	EUR 100	88,714	0.3
				238,285	0.7

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
GEMEINDEVERWALTUNG – KOMMUNALANLEIHEN					
KANADA					
Province of British Columbia Canada	4.25%	11/27/2024	AUD 130	\$ 86,977	0.2%
Province of Ontario Canada	2.70%	06/02/2029	CAD 95	65,075	0.2
Province of Quebec Canada	3.65%	05/20/2032	24	17,146	0.1
				<u>169,198</u>	<u>0.5</u>
ABS-ANLEIHEN					
AUTOS – FESTVERZINSLICH					
Flagship Credit Auto Trust, Series 2018-3, Class D	4.15%	12/16/2024	USD 26	25,617	0.1
				<u>33,670,470</u>	<u>98.9</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
STAMMAKTIE					
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE					
Telstra Corp. Ltd.			10,611	29,647	0.1
Gesamtanlagen					
(Kosten \$33,811,896)				\$ 33,700,117	99.0%
Termineinlagen					
ANZ, Hong Kong(c)	2.09 %	–		2,112	0.0
ANZ, London(c)	2.09 %	–		34	0.0
BBH, Grand Cayman(c)	2.09 %	–		1	0.0
BBH, Grand Cayman(c)	4.10 %	–		1,896	0.0
BNP Paribas, Paris(c)	0.24 %	–		15,446	0.1
BNP Paribas, Paris(c)	0.74 %	–		3,190	0.0
Citibank, New York(c)	3.93 %	–		79,350	0.2
DNB, Oslo(c)	1.79 %	–		16,821	0.1
HSBC, Paris(c)	1.53 %	–		9,479	0.0
HSBC, Singapore(c)	2.56 %	–		179	0.0
Nordea, Oslo(c)	1.60 %	–		2,170	0.0
Scotiabank, Toronto(c)	3.33 %	–		397	0.0
SEB, Stockholm(c)	(0.56)%	–		13,757	0.0
SEB, Stockholm(c)	1.02 %	–		1,059	0.0
SEB, Stockholm(c)	1.79 %	–		38	0.0
SMBC, London(c)	2.92 %	–		2,313	0.0
SMBC, Tokyo(c)	1.53 %	–		435	0.0
SMBC, Tokyo(c)	2.92 %	–		469	0.0
SMBC, Tokyo(c)	3.93 %	–		781,516	2.3
Standard Chartered Bank, Johannesburg(c)	5.62 %	–		496	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>931,158</u>	<u>2.8</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>(595,702)</u>	<u>(1.8)</u>
Nettovermögen				<u>\$ 34,035,573</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Long					
10 Yr Australian Bond Futures	03/15/2023	1	\$ 80,439	\$ 79,174	\$ (1,265)
10 Yr Canadian Bond Futures	06/21/2023	2	177,428	178,058	630
10 Yr Mini Japan Government Bond Futures	03/10/2023	1	107,840	107,737	(103)
Korea 3 Yr Bond Futures	03/21/2023	19	1,497,986	1,480,227	(17,759)
MSCI Emerging Markets Index Futures	03/17/2023	15	736,870	722,175	(14,695)
OMXS30 Index Futures	03/17/2023	2	42,767	42,494	(273)
SPI 200 Futures	03/16/2023	1	125,058	120,724	(4,334)
TOPIX Index Futures	03/09/2023	1	146,414	146,308	(106)
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	06/30/2023	4	816,719	814,906	(1,813)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	06/30/2023	3	322,031	321,164	(867)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	06/21/2023	6	671,250	669,937	(1,313)
U.S. 10 Yr Ultra Futures	06/21/2023	2	234,234	234,375	141
Short					
3 Yr Australian Bond Futures	03/15/2023	1	72,283	71,824	459
Euro STOXX 50 Index Futures	03/17/2023	3	130,416	134,464	(4,048)
Euro-BOBL Futures	03/08/2023	3	379,260	365,478	13,782
Euro-Bund Futures	03/08/2023	1	143,805	140,579	3,226
Euro-OAT Futures	03/08/2023	1	143,868	135,068	8,800
Euro-Schatz Futures	03/08/2023	5	564,399	555,187	9,212
FTSE 100 IDX Futures	03/17/2023	3	283,405	283,288	117
Korea 10 Yr Bond Futures	03/21/2023	2	171,124	165,955	5,169
Long Gilt Futures	06/28/2023	1	121,067	120,237	830

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
MSCI Singapore IX ETS Futures	03/30/2023	3	\$ 66,412	\$ 65,340	\$ 1,072
S&P 500 E-Mini Futures	03/17/2023	7	1,381,803	1,391,425	(9,622)
S&P/TSX 60 IX Futures	03/16/2023	2	354,784	356,643	(1,859)
					\$ (14,619)
				Wertsteigerung	\$ 43,438
				Wertminderung	\$ (58,057)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Bank of America, NA	GBP 436	USD 532	03/24/2023	\$ 7,126
Bank of America, NA	CNH 1,660	USD 244	04/20/2023	4,279
Bank of America, NA	KRW 37,428	USD 30	04/26/2023	2,055
Barclays Bank PLC	BRL 54	USD 11	03/02/2023	313
Barclays Bank PLC	USD 11	BRL 58	03/02/2023	95
Barclays Bank PLC	USD 5	TWD 162	03/16/2023	(125)
Barclays Bank PLC	USD 13	KRW 15,591	04/26/2023	(827)
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF 471	USD 507	03/01/2023	7,392
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 503	CHF 471	03/01/2023	(3,249)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 18	SGD 24	03/02/2023	53
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN 9,042	USD 484	03/16/2023	(8,863)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 22	MXN 425	03/16/2023	750
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 1	THB 19	03/23/2023	(40)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP 288	USD 355	03/24/2023	7,878
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 260	GBP 214	03/24/2023	(3,136)
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD 648	USD 485	03/30/2023	9,690
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 326	CAD 435	03/30/2023	(6,422)
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD 21	USD 14	04/13/2023	417
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 476	AUD 678	04/13/2023	(18,987)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 1,255	USD 1,331	04/20/2023	495
Brown Brothers Harriman & Co.	ILS 97	USD 29	04/20/2023	2,027
Brown Brothers Harriman & Co.	NZD 277	USD 179	04/20/2023	7,805
Brown Brothers Harriman & Co.	NOK 38	USD 4	04/21/2023	153
Brown Brothers Harriman & Co.	SEK 2,629	USD 253	04/21/2023	1,408
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 7	DKK 48	04/21/2023	(237)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 138	SEK 1,439	04/21/2023	(581)
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY 4,428	USD 34	04/28/2023	1,312
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 535	JPY 70,714	04/28/2023	(11,378)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 442	USD 471	05/11/2023	909
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 124	USD 131	05/11/2023	(302)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 74	EUR 70	05/11/2023	(276)
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF 423	USD 456	05/24/2023	2,310
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 0*	USD 0*	03/08/2023	0
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 0*	EUR 0*	03/08/2023	(5)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 0*	USD 0*	03/17/2023	0
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 0*	EUR 0*	03/17/2023	(4)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 113	USD 120	03/24/2023	600
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 10	USD 11	03/24/2023	(28)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,822	EUR 2,648	03/24/2023	(17,508)
Citibank, NA	KRW 183,006	USD 149	04/26/2023	9,814
Citibank, NA	JPY 306,952	USD 2,363	04/28/2023	90,392
HSBC Bank USA	EUR 1,063	USD 1,145	04/20/2023	17,194
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 4	TWD 130	03/16/2023	(51)
Morgan Stanley Capital Services LLC	BRL 278	USD 54	03/02/2023	1,376
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 63	BRL 322	03/02/2023	(1,264)
Morgan Stanley Capital Services LLC	MYR 278	USD 64	03/16/2023	1,642
Morgan Stanley Capital Services LLC	TWD 326	USD 11	03/16/2023	217
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 49	TWD 1,467	03/16/2023	(1,126)
Morgan Stanley Capital Services LLC	BRL 322	USD 62	04/04/2023	1,248
Morgan Stanley Capital Services LLC	AUD 1,103	USD 771	04/13/2023	28,184
Morgan Stanley Capital Services LLC	IDR 1,001,536	USD 65	04/13/2023	(227)
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR 1,255	USD 1,334	04/27/2023	2,397
Standard Chartered Bank	BRL 48	USD 9	03/02/2023	135
Standard Chartered Bank	TWD 3,876	USD 129	03/16/2023	2,717
				\$ 137,747
			Wertsteigerung	\$ 212,383
			Wertminderung	\$ (74,636)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss-datum	Nominal-betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Verkaufskontrakte					
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 39, 5 Year Index	12/20/2027	USD 350	\$ 5,124	\$ (2,288)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal-betrag (000)	Abschluss-datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	HUF 5,118	01/23/2033	7.590%	6 Month BUBOR	\$ 618
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	HUF 3,070	01/24/2033	7.720%	6 Month BUBOR	300
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	HUF 5,118	01/24/2033	7.800%	6 Month BUBOR	427
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	HUF 5,118	01/27/2033	7.670%	6 Month BUBOR	544
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	HUF 5,117	02/13/2033	7.685%	6 Month BUBOR	532
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	EUR 176	05/12/2027	6 Month EURIBOR	1.494%	(13,764)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	EUR 134	05/13/2027	6 Month EURIBOR	1.464%	(10,645)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	NZD 100	11/01/2024	3 Month BKBM	2.580%	(3,108)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	NZD 270	11/02/2024	3 Month BKBM	2.503%	(8,232)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	EUR 100	09/30/2050	0.122%	6 Month EURIBOR	40,058
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	EUR 100	09/30/2050	6 Month EURIBOR	(0.017)%	(38,527)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	EUR 100	11/10/2050	0.022%	6 Month EURIBOR	38,980
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	EUR 100	11/10/2050	6 Month EURIBOR	(0.043)%	(38,258)
Insgesamt					\$ (31,075)
				Wertsteigerung	\$ 81,459
				Wertminderung	\$ (112,534)

TOTAL-RETURN-SWAPS

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahler/Erhaltener Zinssatz	Nominal-betrag (000)	Fälligkeits-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Gesamtrendite auf Referenz-Obligation erhalten					
Bank of America, NA					
Bloomberg Commodity Index	3,361	0.10%	USD 1,065	03/15/2023	\$ (50,189)
Bloomberg Commodity Index	295	0.10%	USD 93	03/15/2023	(4,405)
JPMorgan Chase Bank, NA					
FTSE EPRA/NAREIT Developed Real Estate Index	52	OBFR plus 0.53%	USD 289	05/15/2023	(9,100)
UBS AG					
FTSE EPRA/NAREIT Developed Real Estate Index	181	OBFR plus 0.39%	USD 957	09/15/2023	16,351
Gesamtrendite auf Referenz-Obligation zahlen					
Morgan Stanley Capital Services LLC					
Swiss Market Index Futures	10	0.00%	CHF 112	03/17/2023	2,311
Insgesamt					\$ (45,032)
				Wertsteigerung	\$ 18,662
				Wertminderung	\$ (63,694)
Swaps insgesamt					\$ (78,395)

* Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

- (a) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (b) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 28. Februar 2023.
- (c) Tagesgeld.

Währungskürzel:

- AUD – Australian Dollar
- BRL – Brazilian Real
- CAD – Canadian Dollar
- CHF – Swiss Franc
- CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
- DKK – Danish Krone
- EUR – Euro

GBP	–	Great British Pound
HUF	–	Hungarian Forint
IDR	–	Indonesian Rupiah
ILS	–	Israeli Shekel
JPY	–	Japanese Yen
KRW	–	South Korean Won
MXN	–	Mexican Peso
MYR	–	Malaysian Ringgit
NOK	–	Norwegian Krone
NZD	–	New Zealand Dollar
PEN	–	Peruvian Sol
SEK	–	Swedish Krona
SGD	–	Singapore Dollar
THB	–	Thailand Baht
TWD	–	New Taiwan Dollar
USD	–	United States Dollar

Glossar:

ADR	–	American Depositary Receipt
BKBM	–	Bank Bill Benchmark (New Zealand)
BOBL	–	Bundesobligationen
BUBOR	–	Budapest Interbank Offered Rate
CBT	–	Chicago Board of Trade
CME	–	Chicago Mercantile Exchange
EPRA	–	European Public Real Estate Association
ETS	–	Emission Trading Scheme
EURIBOR	–	Euro Interbank Offered Rate
FTSE	–	Financial Times Stock Exchange
GDR	–	Global Depositary Receipt
INTRCONX	–	Inter-Continental Exchange
LCH	–	London Clearing House
MSCI	–	Morgan Stanley Capital International
NAREIT	–	National Association of Real Estate Investment Trusts
OAT	–	Obligations Assimilables du Trésor
OBFR	–	Overnight Bank Funding Rate
OMXS	–	Stockholm Stock Exchange
REG	–	Registered Shares
REIT	–	Real Estate Investment Trust
SPI	–	Share Price Index
TBA	–	To Be Announced
TOPIX	–	Tokyo Price Index
TSX	–	Toronto Stock Exchange

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONS-AUSRÜSTUNG			
Calix, Inc.	13,830	\$ 707,416	0.7%
Lumentum Holdings, Inc.	13,193	709,922	0.8
		<u>1,417,338</u>	<u>1.5</u>
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Flex Ltd.	62,587	1,424,481	1.5
Keyence Corp.	1,162	502,424	0.5
Keysight Technologies, Inc.	3,813	609,852	0.7
		<u>2,536,757</u>	<u>2.7</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Accenture PLC - Class A	3,519	934,490	1.0
BIPROGY, Inc.	21,514	476,741	0.5
Visa, Inc. - Class A	8,597	1,890,844	2.0
		<u>3,302,075</u>	<u>3.5</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Advanced Micro Devices, Inc.	4,725	371,288	0.4
ASML Holding NV	1,368	843,249	0.9
Infineon Technologies AG	24,345	861,235	0.9
MediaTek, Inc.	22,132	519,627	0.6
NXP Semiconductors NV	7,473	1,333,917	1.4
ON Semiconductor Corp.	9,930	768,667	0.8
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	97,479	1,612,689	1.8
		<u>6,310,672</u>	<u>6.8</u>
SOFTWARE			
ACI Worldwide, Inc.	19,755	510,658	0.5
Adobe, Inc.	1,975	639,664	0.7
CommVault Systems, Inc.	10,423	613,726	0.7
Dassault Systemes SE	21,174	817,092	0.9
Gen Digital, Inc.	27,829	542,938	0.6
Intuit, Inc.	1,441	586,606	0.6
Microsoft Corp.	4,429	1,104,767	1.2
Oracle Corp.	13,671	1,194,889	1.3
		<u>6,010,340</u>	<u>6.5</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Dell Technologies, Inc. - Class C	11,113	451,650	0.5
Samsung Electronics Co., Ltd.	14,399	658,832	0.7
Western Digital Corp.	16,025	616,626	0.7
		<u>1,727,108</u>	<u>1.9</u>
		<u>21,304,290</u>	<u>22.9</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank Leumi Le-Israel BM	46,700	363,069	0.4
Bank of Ireland Group PLC	61,109	673,248	0.7
Comerica, Inc.	9,104	638,186	0.7
Erste Group Bank AG	31,215	1,225,267	1.3
First Citizens BancShares, Inc./NC - Class A	830	608,774	0.7
HDFC Bank Ltd.	48,709	944,047	1.0
KB Financial Group, Inc.	14,442	559,319	0.6
NatWest Group PLC	223,601	785,498	0.8
Resona Holdings, Inc. (a)	136,529	751,983	0.8
SVB Financial Group	1,898	546,891	0.6
Wells Fargo & Co.	23,791	1,112,700	1.2
		<u>8,208,982</u>	<u>8.8</u>
KAPITALMÄRKTE			
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	207,802	418,744	0.5
Deutsche Boerse AG	4,523	788,663	0.8
London Stock Exchange Group PLC	5,431	484,563	0.5
MSCI, Inc.	2,363	1,233,732	1.3
Partners Group Holding AG	1,036	980,918	1.1
		<u>3,906,620</u>	<u>4.2</u>
VERSICHERUNGEN			
Aflac, Inc.	13,954	950,979	1.0
AIA Group Ltd.	74,048	786,979	0.9
Intact Financial Corp.	0*	10	0.0
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	96,286	657,298	0.7

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Willis Towers Watson PLC	2,114	\$ 495,473	0.5%
		<u>2,890,739</u>	<u>3.1</u>
		<u>15,006,341</u>	<u>16.1</u>
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
Airbus SE	6,310	826,432	0.9
Hexcel Corp.	11,713	854,465	0.9
Spirit AeroSystems Holdings, Inc. - Class A	13,778	470,941	0.5
		<u>2,151,838</u>	<u>2.3</u>
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Tetra Tech, Inc.	6,492	888,653	1.0
TOMRA Systems ASA	40,085	639,395	0.7
Waste Management, Inc.	8,229	1,232,360	1.3
		<u>2,760,408</u>	<u>3.0</u>
BAU- UND INGENIEURWESEN			
Dycom Industries, Inc.	8,768	738,331	0.8
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Vertiv Holdings Co.	29,169	473,997	0.5
MASCHINEN			
Alstom SA	17,569	515,628	0.5
Amada Co., Ltd.	99,994	909,955	1.0
Deere & Co.	3,406	1,427,924	1.5
SMC Corp.	1,754	891,382	1.0
Xylem, Inc./NY	5,200	533,743	0.6
		<u>4,278,632</u>	<u>4.6</u>
SCHIFFFAHRT			
Star Bulk Carriers Corp. (a)	20,680	506,865	0.5
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Experian PLC	16,359	551,522	0.6
Robert Half International, Inc.	9,322	751,555	0.8
		<u>1,303,077</u>	<u>1.4</u>
STRASSE UND SCHIENE			
XPO, Inc.	12,668	422,603	0.5
		<u>12,635,751</u>	<u>13.6</u>
GESUNDHEITSWESEN			
BIOTECHNOLOGIE			
Abcam PLC (Sponsored ADR)	36,621	527,714	0.6
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Alcon, Inc.	9,376	639,299	0.7
Becton Dickinson and Co.	4,016	941,836	1.0
Medtronic PLC	9,317	771,440	0.8
STERIS PLC	4,796	901,884	1.0
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	5,978	740,468	0.8
		<u>3,994,927</u>	<u>4.3</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Apollo Hospitals Enterprise Ltd.	13,380	708,862	0.7
Centene Corp.	9,311	636,850	0.7
		<u>1,345,712</u>	<u>1.4</u>
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Bio-Rad Laboratories, Inc. - Class A	1,584	756,814	0.8
Bruker Corp.	9,178	632,565	0.7
Danaher Corp.	4,528	1,120,807	1.2
ICON PLC	3,451	778,537	0.8
West Pharmaceutical Services, Inc.	2,627	832,841	0.9
		<u>4,121,564</u>	<u>4.4</u>
PHARMAZEUTIKA			
Roche Holding AG (Genusschein)	3,866	1,114,817	1.2
Sanofi	7,939	742,260	0.8
		<u>1,857,077</u>	<u>2.0</u>
		<u>11,846,994</u>	<u>12.7</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Aptiv PLC	5,656	657,699	0.7
Faurecia SE	27,185	592,938	0.6
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	32,717	371,663	0.4
		<u>1,622,300</u>	<u>1.7</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KRAFTFAHRZEUGE			
BYD Co., Ltd. - Class H	18,639	\$ 501,085	0.5%
Stellantis NV	46,341	807,701	0.9
		<u>1,308,786</u>	<u>1.4</u>
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
ADT, Inc.	86,413	651,551	0.7
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Entain PLC	42,549	694,862	0.8
Hyatt Hotels Corp. - Class A	6,703	779,164	0.8
Tongcheng Travel Holdings Ltd.	188,193	373,558	0.4
		<u>1,847,584</u>	<u>2.0</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Midea Group Co., Ltd. - Class A	52,315	394,340	0.4
PulteGroup, Inc.	16,815	919,272	1.0
TopBuild Corp.	2,413	500,876	0.6
		<u>1,814,488</u>	<u>2.0</u>
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	72,799	363,648	0.4
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Carter's, Inc.	9,354	705,202	0.7
Tapestry, Inc.	16,300	709,204	0.8
		<u>1,414,406</u>	<u>1.5</u>
		<u>9,022,763</u>	<u>9.7</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Coca-Cola Co. (The)	16,114	958,947	1.0
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Atacadao SA	159,229	409,063	0.4
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Hain Celestial Group, Inc. (The)	25,082	447,220	0.5
Nomad Foods Ltd.	23,037	412,830	0.4
Salmar ASA	6,557	271,807	0.3
		<u>1,131,857</u>	<u>1.2</u>
HAUSHALTSPRODUKTE			
Procter & Gamble Co. (The)	4,713	648,274	0.7
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE			
Dabur India Ltd.	88,405	569,141	0.6
Haleon PLC	147,687	571,499	0.6
Unilever PLC	13,694	681,810	0.8
		<u>1,822,450</u>	<u>2.0</u>
		<u>4,970,591</u>	<u>5.3</u>
VERSORGUNG			
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE			
EDP - Energias de Portugal SA	194,612	980,013	1.1
Enel SpA	180,936	1,014,971	1.1
Orsted AS	7,457	649,095	0.7
		<u>2,644,079</u>	<u>2.9</u>
GASVERSORGUNGSBETRIEBE			
China Resources Gas Group Ltd.	89,812	378,980	0.4
Kunlun Energy Co., Ltd.	611,674	490,100	0.5
		<u>869,080</u>	<u>0.9</u>
WASSERVERSORGER			
American Water Works Co., Inc.	3,926	551,124	0.6
		<u>4,064,283</u>	<u>4.4</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Chr Hansen Holding A/S (a)	9,727	674,309	0.7
Koninklijke DSM NV	5,195	640,126	0.7
LyondellBasell Industries NV - Class A	9,834	943,962	1.0
		<u>2,258,397</u>	<u>2.4</u>
METALL UND BERGBAU			
ArcelorMittal SA	24,756	742,925	0.8
ATI, Inc.	14,246	579,098	0.6
Endeavour Mining PLC	21,041	429,168	0.5
		<u>1,751,191</u>	<u>1.9</u>
		<u>4,009,588</u>	<u>4.3</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE					
Charter Communications, Inc. - Class A			3,018	\$ 1,109,586	1.2%
Comcast Corp. - Class A			24,589	913,984	1.0
Deutsche Telekom AG (REG)			32,221	723,146	0.8
				<u>2,746,716</u>	<u>3.0</u>
UNTERHALTUNG					
Electronic Arts, Inc.			5,979	663,326	0.7
				<u>3,410,042</u>	<u>3.7</u>
ENERGIE					
ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE					
Baker Hughes Co.			18,679	571,576	0.6
Shell PLC			53,279	1,619,135	1.8
				<u>2,190,711</u>	<u>2.4</u>
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
Cameco Corp.			21,753	594,725	0.6
				<u>2,785,436</u>	<u>3.0</u>
IMMOBILIEN					
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)					
Americold Realty Trust, Inc.			23,775	698,982	0.7
Gesamtanlagen					
(Kosten \$92,780,727)				<u>\$ 89,755,061</u>	<u>96.4%</u>
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	2.09 %	–		2	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.24 %	–		9,153	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.74 %	–		25,700	0.1
Citibank, New York(b)	3.93 %	–		2,610,217	2.8
DNB, Oslo(b)	1.79 %	–		4,897	0.0
HSBC, Paris(b)	1.53 %	–		13,490	0.0
JPMorgan Chase, New York(b)	3.93 %	–		761,644	0.8
Nordea, Oslo(b)	1.60 %	–		8,907	0.0
SEB, Stockholm(b)	(0.56)%	–		4,731	0.0
SEB, Stockholm(b)	1.02 %	–		4,505	0.0
SMBC, London(b)	2.92 %	–		8,042	0.0
SMBC, Tokyo(b)	1.53 %	–		4,790	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	(0.56)%	–		4,368	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>3,460,446</u>	<u>3.7</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>(74,258)</u>	<u>(0.1)</u>
Nettovermögen				<u>\$ 93,141,249</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA	CHF 238	USD 257	03/01/2023	\$ 4,220
Bank of America, NA	USD 161	CHF 148	03/01/2023	(2,990)
Bank of America, NA	USD 124	BRL 642	03/02/2023	(1,866)
Bank of America, NA	INR 44,611	USD 537	03/16/2023	(2,530)
Bank of America, NA	TWD 3,606	USD 120	03/16/2023	2,079
Bank of America, NA	GBP 716	USD 873	03/24/2023	11,690
Bank of America, NA	USD 1,375	CAD 1,840	03/30/2023	(26,413)
Bank of America, NA	USD 98	AUD 142	04/13/2023	(2,548)
Bank of America, NA	CNH 19,463	USD 2,859	04/20/2023	49,445
Bank of America, NA	EUR 2,045	USD 2,177	05/11/2023	4,663
Barclays Bank PLC	USD 87	INR 7,254	03/16/2023	239
Barclays Bank PLC	HKD 3,559	USD 458	07/12/2023	2,013
BNP Paribas SA	USD 167	TWD 5,036	03/16/2023	(3,321)
BNP Paribas SA	NOK 4,398	USD 443	04/21/2023	18,040
BNP Paribas SA	USD 332	SEK 3,444	04/21/2023	(1,758)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 0**	USD 1	03/24/2023	(1)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 220	USD 234	03/24/2023	921
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 4,214	EUR 3,954	03/24/2023	(26,144)
Citibank, NA	INR 70,948	USD 853	03/16/2023	(4,427)
Citibank, NA	KRW 1,257,316	USD 1,022	04/26/2023	67,928
Citibank, NA	USD 589	KRW 725,165	04/26/2023	(39,178)
Citibank, NA	USD 1,178	JPY 152,972	04/28/2023	(45,048)
Citibank, NA	EUR 1,859	USD 1,979	05/11/2023	5,045
Goldman Sachs Bank USA	USD 1,228	CNH 8,363	04/20/2023	(20,522)

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
HSBC Bank USA	ILS	1,217	USD	359	04/20/2023	\$ 25,368
JPMorgan Chase Bank	NOK	1,254	USD	121	04/21/2023	136
Morgan Stanley Capital Services LLC	CHF	439	USD	474	03/01/2023	8,438
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	664	CHF	621	03/01/2023	(4,533)
Morgan Stanley Capital Services LLC	BRL	4,338	USD	849	03/02/2023	20,110
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	852	BRL	4,364	03/02/2023	(18,486)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	385	TWD	11,609	03/16/2023	(6,640)
Morgan Stanley Capital Services LLC	BRL	3,040	USD	589	04/04/2023	11,785
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	256	BRL	1,324	04/04/2023	(5,133)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	860	AUD	1,229	04/13/2023	(31,419)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	112	ZAR	2,018	04/20/2023	(3,090)
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR	117	USD	125	05/11/2023	400
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	84	EUR	79	05/11/2023	(268)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CHF	517	USD	556	05/24/2023	2,377
Royal Bank of Scotland PLC	CHF	93	USD	102	03/01/2023	3,782
Standard Chartered Bank	INR	13,885	USD	167	03/16/2023	(1,091)
Standard Chartered Bank	TWD	50,399	USD	1,677	03/16/2023	35,332
Standard Chartered Bank	USD	184	TWD	5,503	03/16/2023	(4,292)
UBS AG	BRL	668	USD	130	03/02/2023	2,623
UBS AG	KRW	178,238	USD	140	04/26/2023	4,675
						\$ 29,611
					Wertsteigerung	\$ 281,309
					Wertminderung	\$ (251,698)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

* Anteilsbetrag weniger als 0.50.

** Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500

(a) Stellt sämtliche oder einen Teil der verliehenen Wertpapiere dar. Informationen zur Wertpapierleihe finden Sie in Anmerkung N.

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD	– Australian Dollar
BRL	– Brazilian Real
CAD	– Canadian Dollar
CHF	– Swiss Franc
CNH	– Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
EUR	– Euro
GBP	– Great British Pound
HKD	– Hong Kong Dollar
ILS	– Israeli Shekel
INR	– Indian Rupee
JPY	– Japanese Yen
KRW	– South Korean Won
NOK	– Norwegian Krone
SEK	– Swedish Krona
TWD	– New Taiwan Dollar
USD	– United States Dollar
ZAR	– South African Rand

Glossar:

ADR	– American Depositary Receipt
REG	– Registered Shares
REIT	– Real Estate Investment Trust

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Faurecia SE	373,881	\$ 8,154,648	1.3%
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	449,953	5,111,468	0.8
		<u>13,266,116</u>	<u>2.1</u>
KRAFTFAHRZEUGE			
Stellantis NV	637,331	11,108,278	1.7
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
ADT, Inc.	1,188,429	8,960,758	1.4
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Entain PLC	585,181	9,556,408	1.5
Hyatt Hotels Corp. - Class A	92,187	10,715,810	1.6
Tongcheng Travel Holdings Ltd.	2,588,207	5,137,534	0.8
		<u>25,409,752</u>	<u>3.9</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Midea Group Co., Ltd. - Class A	719,485	5,423,345	0.8
PulteGroup, Inc.	231,255	12,642,714	2.0
		<u>18,066,059</u>	<u>2.8</u>
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	1,001,201	5,001,232	0.8
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Carter's, Inc.	128,646	9,698,618	1.5
Tapestry, Inc.	224,170	9,753,646	1.5
		<u>19,452,264</u>	<u>3.0</u>
		<u>101,264,459</u>	<u>15.7</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank Leumi Le-Israel BM	642,260	4,993,269	0.8
Bank of Ireland Group PLC	840,433	9,259,147	1.4
Comerica, Inc.	125,206	8,776,945	1.3
First Citizens BancShares, Inc./NC - Class A	11,410	8,372,448	1.3
KB Financial Group, Inc.	198,618	7,692,300	1.2
NatWest Group PLC	3,075,177	10,802,923	1.7
Resona Holdings, Inc. (a)	1,877,671	10,341,992	1.6
Wells Fargo & Co.	327,195	15,302,915	2.4
		<u>75,541,939</u>	<u>11.7</u>
KAPITALMÄRKTE			
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	2,857,898	5,758,974	0.9
VERSICHERUNGEN			
Intact Financial Corp.	1	134	0.0
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	1,324,214	9,039,796	1.4
Willis Towers Watson PLC	29,076	6,814,216	1.1
		<u>15,854,146</u>	<u>2.5</u>
		<u>97,155,059</u>	<u>15.1</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
BIPROGY, Inc.	295,886	6,556,595	1.0
Visa, Inc. - Class A	50,396	11,084,020	1.7
		<u>17,640,615</u>	<u>2.7</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
NXP Semiconductors NV	35,816	6,392,400	1.0
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	765,350	12,661,873	2.0
		<u>19,054,273</u>	<u>3.0</u>
SOFTWARE			
ACI Worldwide, Inc.	271,685	7,023,066	1.1
CommVault Systems, Inc.	143,352	8,440,546	1.3
Gen Digital, Inc.	382,727	7,467,009	1.2
Oracle Corp.	188,024	16,433,254	2.5
		<u>39,363,875</u>	<u>6.1</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Samsung Electronics Co., Ltd.	198,031	9,060,887	1.4
Western Digital Corp.	220,385	8,480,431	1.3
		<u>17,541,318</u>	<u>2.7</u>
		<u>93,600,081</u>	<u>14.5</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
Airbus SE	86,782	\$ 11,365,880	1.8%
Spirit AeroSystems Holdings, Inc. - Class A	189,492	6,476,828	1.0
		<u>17,842,708</u>	<u>2.8</u>
BAU- UND INGENIEURWESEN			
Dycom Industries, Inc.	120,582	10,154,233	1.6
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Vertiv Holdings Co.	401,161	6,518,865	1.0
MASCHINEN			
Alstom SA	241,630	7,091,406	1.1
Amada Co., Ltd.	1,375,207	12,514,573	1.9
		<u>19,605,979</u>	<u>3.0</u>
SCHIFFFAHRT			
Star Bulk Carriers Corp. (a)	284,410	6,970,891	1.1
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Robert Half International, Inc.	128,208	10,336,113	1.6
STRASSE UND SCHIENE			
XPO, Inc.	174,222	5,812,047	0.9
		<u>77,240,836</u>	<u>12.0</u>
GESUNDHEITSWESEN			
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Medtronic PLC	128,135	10,609,586	1.6
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	82,212	10,183,627	1.6
		<u>20,793,213</u>	<u>3.2</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Centene Corp.	128,049	8,758,574	1.4
PHARMAZEUTIKA			
Roche Holding AG (Genusschein)	53,174	15,332,038	2.3
Sanofi	109,181	10,208,265	1.6
		<u>25,540,303</u>	<u>3.9</u>
		<u>55,092,090</u>	<u>8.5</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Charter Communications, Inc. - Class A	41,512	15,260,087	2.4
Comcast Corp. - Class A	338,176	12,569,991	2.0
Deutsche Telekom AG (REG)	443,139	9,945,392	1.5
		<u>37,775,470</u>	<u>5.9</u>
UNTERHALTUNG			
Electronic Arts, Inc.	82,231	9,122,692	1.4
		<u>46,898,162</u>	<u>7.3</u>
VERSORGUNG			
STROMVERSORGBETRIEBE			
EDP - Energias de Portugal SA	2,676,490	13,478,069	2.1
Enel SpA	2,488,404	13,958,859	2.1
		<u>27,436,928</u>	<u>4.2</u>
GASVERSORGBETRIEBE			
China Resources Gas Group Ltd.	1,235,188	5,212,090	0.8
Kunlun Energy Co., Ltd.	8,412,326	6,740,330	1.1
		<u>11,952,420</u>	<u>1.9</u>
		<u>39,389,348</u>	<u>6.1</u>
ENERGIE			
ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE			
Baker Hughes Co.	256,891	7,860,865	1.2
Shell PLC	732,739	22,267,889	3.5
		<u>30,128,754</u>	<u>4.7</u>
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
Cameco Corp.	299,167	8,179,228	1.2
		<u>38,307,982</u>	<u>5.9</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
LyondellBasell Industries NV - Class A	135,246	12,982,267	2.0
METALL UND BERGBAU			
ArcelorMittal SA	340,474	10,217,419	1.6
ATI, Inc.	195,924	7,964,313	1.2

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettovermögen %
Endeavour Mining PLC			289,374	\$ 5,902,325	0.9%
				<u>24,084,057</u>	<u>3.7</u>
				<u>37,066,324</u>	<u>5.7</u>
VERBRAUCHSGÜTER					
GETRÄNKE					
Coca-Cola Co. (The)			221,616	13,188,365	2.0
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL					
Atacadao SA			2,189,871	5,625,832	0.9
LEBENSMITTELPRODUKTE					
Hain Celestial Group, Inc. (The)			344,958	6,150,593	0.9
Nomad Foods Ltd.			316,833	5,677,640	0.9
Salmar ASA			90,173	3,738,148	0.6
				<u>15,566,381</u>	<u>2.4</u>
				<u>34,380,578</u>	<u>5.3</u>
IMMOBILIEN					
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)					
Americold Realty Trust, Inc.			326,975	9,613,068	1.5
Gesamtanlagen					
(Kosten \$658,552,229)				\$ 630,007,987	97.6%
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	2.09 %	–		30	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.24 %	–		64,652	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.74 %	–		63,899	0.0
JPMorgan Chase, New York(b)	3.93 %	–		10,475,361	1.7
Nordea, Oslo(b)	1.60 %	–		63,042	0.0
Scotiabank, Toronto(b)	3.33 %	–		2	0.0
SEB, Stockholm(b)	(0.56)%	–		65,064	0.0
SEB, Stockholm(b)	1.79 %	–		1	0.0
SMBC, London(b)	2.92 %	–		62,398	0.0
SMBC, Tokyo(b)	1.53 %	–		66,013	0.0
Standard Chartered Bank, Johannesburg(b)	5.62 %	–		272	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>10,860,734</u>	<u>1.7</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>4,669,500</u>	<u>0.7</u>
Nettovermögen				<u>\$ 645,538,221</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA	CHF 3,272	USD 3,532	03/01/2023	\$ 58,040
Bank of America, NA	USD 1,712	BRL 8,830	03/02/2023	(25,657)
Bank of America, NA	TWD 49,600	USD 1,644	03/16/2023	28,594
Bank of America, NA	CNH 260,988	USD 38,351	04/20/2023	672,943
BNP Paribas SA	USD 2,302	TWD 69,256	03/16/2023	(45,672)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 1,341	USD 915	03/24/2023	12,060
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 158	USD 117	03/24/2023	917
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 60	USD 64	03/24/2023	319
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 537	USD 649	03/24/2023	2,270
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 315	USD 235	03/24/2023	1,547
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 15,601	AUD 22,873	03/24/2023	(196,575)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,049	CAD 4,131	03/24/2023	(20,633)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,333	EUR 1,250	03/24/2023	(8,269)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1	GBP 0*	03/24/2023	0
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 14,742	GBP 12,187	03/24/2023	(75,791)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 6,073	SGD 8,128	03/24/2023	(42,028)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 4,694	ZAR 85,726	03/24/2023	(34,920)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 6,686	USD 367	03/24/2023	3,368
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 242	USD 13	03/24/2023	(42)
Citibank, NA	KRW 17,291,822	USD 14,056	04/26/2023	934,206
Citibank, NA	EUR 25,564	USD 27,221	05/11/2023	69,383
HSBC Bank USA	ILS 16,744	USD 4,940	04/20/2023	348,881
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 3,512	CHF 3,272	03/01/2023	(38,199)
Morgan Stanley Capital Services LLC	BRL 41,447	USD 8,122	03/02/2023	205,082
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 8,149	BRL 41,806	03/02/2023	(164,141)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 5,292	TWD 159,652	03/16/2023	(91,315)
Morgan Stanley Capital Services LLC	BRL 41,806	USD 8,095	04/04/2023	162,085
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR 1,616	USD 1,721	05/11/2023	5,500
Morgan Stanley Capital Services LLC	CHF 1,840	USD 1,980	05/24/2023	8,467

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Standard Chartered Bank	TWD	512,128	USD	17,042	03/16/2023	\$ 359,028
Standard Chartered Bank	USD	1,547	TWD	46,382	03/16/2023	(36,172)
UBS AG	BRL	9,189	USD	1,791	03/02/2023	36,076
UBS AG	KRW	2,451,295	USD	1,924	04/26/2023	64,289
						<u>\$ 2,193,641</u>
					Wertsteigerung	\$ 2,973,055
					Wertminderung	\$ (779,414)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

* Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

(a) Stellt sämtliche oder einen Teil der verliehenen Wertpapiere dar. Informationen zur Wertpapierleihe finden Sie in Anmerkung N.

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dolla
 BRL – Brazilian Real
 CAD – Canadian Dollar
 CHF – Swiss Franc
 CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
 EUR – Euro
 GBP – Great British Pound
 ILS – Israeli Shekel
 KRW – South Korean Won
 SGD – Singapore Dollar
 TWD – New Taiwan Dollar
 USD – United States Dollar
 ZAR – South African Rand

Glossar:

REG – Registered Shares
 REIT – Real Estate Investment Trust

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Samsung SDI Co., Ltd.	39,670	\$ 20,841,665	3.4%
Sinbon Electronics Co., Ltd.	1,609,000	15,664,289	2.5
		<u>36,505,954</u>	<u>5.9</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
FPT Corp.	199,881	677,080	0.1
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
ASPEED Technology, Inc.	124,100	11,154,433	1.8
Broadcom, Inc.	20,150	11,974,944	1.9
MediaTek, Inc.	616,000	14,463,083	2.3
Silergy Corp.	383,000	7,206,562	1.2
SK Hynix, Inc.	113,010	7,637,757	1.2
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	3,556,000	58,830,093	9.4
		<u>111,266,872</u>	<u>17.8</u>
SOFTWARE			
TOTVS SA	1,158,900	6,040,814	1.0
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Samsung Electronics Co., Ltd.	474,140	21,694,240	3.5
		<u>176,184,960</u>	<u>28.3</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
Fu Shou Yuan International Group Ltd.	7,079,000	5,336,972	0.9
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Galaxy Entertainment Group Ltd.	1,571,000	10,459,152	1.7
H World Group Ltd.	1,347,100	6,404,511	1.0
Sands China Ltd.	3,950,000	13,708,922	2.2
Shanghai Jinjiang International Hotels Co., Ltd. - Class A	1,038,032	9,266,198	1.5
		<u>39,838,783</u>	<u>6.4</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd.	2,525,300	27,756,694	4.5
JD.com, Inc. - Class A	657,253	14,610,689	2.4
Meituan - Class B	657,900	11,417,810	1.8
MercadoLibre, Inc.	9,900	12,078,000	1.9
		<u>65,863,193</u>	<u>10.6</u>
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
China Tourism Group Duty Free Corp., Ltd. - Class A	498,100	14,168,253	2.3
Lojas Renner SA	2,387,000	8,503,099	1.3
		<u>22,671,352</u>	<u>3.6</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
ANTA Sports Products Ltd.	466,400	6,158,921	1.0
Li Ning Co., Ltd.	1,750,500	14,936,500	2.4
Samsonite International SA	3,255,600	9,136,601	1.4
		<u>30,232,022</u>	<u>4.8</u>
		<u>163,942,322</u>	<u>26.3</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Al Rajhi Bank	572,262	10,701,721	1.7
Bank for Foreign Trade of Vietnam JSC	3,147,307	12,383,851	2.0
Bank Mandiri Persero Tbk PT	5,418,000	3,551,772	0.6
HDFC Bank Ltd.	1,217,849	23,603,769	3.8
Itau Unibanco Holding SA (Preference Shares)	1,445,400	7,020,700	1.1
Kasikornbank PCL (Foreign Shares)	2,453,300	9,508,531	1.5
NU Holdings Ltd. - Class A	2,715,550	13,686,372	2.2
		<u>80,456,716</u>	<u>12.9</u>
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
Housing Development Finance Corp., Ltd.	569,303	17,971,303	2.9
VERSICHERUNGEN			
AIA Group Ltd.	2,314,800	24,601,734	3.9
		<u>123,029,753</u>	<u>19.7</u>
INDUSTRIEGÜTER			
BAU- UND INGENIEURWESEN			
Sinopec Engineering Group Co., Ltd. - Class H	14,221,500	7,125,009	1.2

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG					
Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. - Class A			211,500	\$ 12,253,980	2.0%
Ecopro BM Co., Ltd.			26,584	3,338,465	0.5
Sungrow Power Supply Co., Ltd. - Class A			277,599	4,766,133	0.7
Suzhou Maxwell Technologies Co., Ltd. Class A			79,900	4,213,770	0.7
				<u>24,572,348</u>	<u>3.9</u>
MASCHINEN					
Estun Automation Co., Ltd. Class A			1,417,900	5,046,650	0.8
				<u>36,744,007</u>	<u>5.9</u>
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA (Sponsored ADR)			131,870	11,703,463	1.9
METALL UND BERGBAU					
Freeport-McMoRan, Inc.			460,260	18,856,852	3.0
				<u>30,560,315</u>	<u>4.9</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN					
Tencent Holdings Ltd.			600,700	26,387,794	4.2
VERBRAUCHSGÜTER					
GETRÄNKE					
Kweichow Moutai Co., Ltd. - Class A			35,592	9,297,454	1.5
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL					
Dino Polska SA			19,510	1,628,764	0.3
TABAK					
ITC Ltd.			1,386,510	6,318,481	1.0
				<u>17,244,699</u>	<u>2.8</u>
GESUNDHEITSWESEN					
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN					
Apollo Hospitals Enterprise Ltd.			103,576	5,487,378	0.9
Universal Vision Biotechnology Co., Ltd.			735,400	7,806,219	1.2
				<u>13,293,597</u>	<u>2.1</u>
VERSORGUNG					
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE					
Equatorial Energia SA			2,495,000	12,118,891	1.9
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
Reliance Industries Ltd.			308,159	8,629,329	1.4
				<u>608,135,667</u>	<u>97.5</u>
AKTIENANLEIHEN					
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
IT-DIENSTLEISTUNGEN					
FPT Corp. Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2023			1,904,392	6,457,604	1.0
				<u>614,593,271</u>	<u>98.5</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
STAMMAKTIE					
INDUSTRIEGÜTER					
STRASSE UND SCHIENE					
Globaltrans Investment PLC (Sponsored GDR) (a)			941,672	1	0.0
Gesamtanlagen				<u>\$ 614,593,272</u>	<u>98.5%</u>
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	2.09 %	–		4,267	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.24 %	–		1,112	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.74 %	–		96,968	0.0
DBS Bank, Singapore(b)	3.93 %	–		7,501,828	1.2
HSBC Bank PLC, London(b)	2.92 %	–		139,858	0.1
HSBC, Singapore(b)	2.56 %	–		51,388	0.0
Scotiabank, Toronto(b)	3.33 %	–		106	0.0
SEB, Stockholm(b)	1.79 %	–		87	0.0
SMBC, Tokyo(b)	1.53 %	–		55,361	0.0
Standard Chartered Bank, Johannesburg(b)	5.62 %	–		63,073	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>7,914,048</u>	<u>1.3</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>1,200,685</u>	<u>0.2</u>
Nettovermögen				<u>\$ 623,708,005</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	AUD	367	USD	251	03/24/2023	\$ 3,275
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	AUD	160	USD	108	03/24/2023	(239)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	PLN	50	USD	11	03/24/2023	(40)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD	2	USD	1	03/24/2023	5
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	4,967	AUD	7,282	03/24/2023	(62,584)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	181	PLN	808	03/24/2023	188
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	26	SGD	35	03/24/2023	(181)
						\$ (59,576)
					Wertsteigerung	\$ 3,468
					Wertminderung	\$ (63,044)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar

PLN – Polish Zloty

SGD – Singapore Dollar

USD – United States Dollar

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt

GDR – Global Depositary Receipt

JSC – Joint Stock Company

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KRAFTFAHRZEUGE			
Great Wall Motor Co., Ltd. - Class H (a)	4,696,500	\$ 6,222,590	1.7%
Kia Corp.	97,880	5,569,896	1.5
Maruti Suzuki India Ltd.	103,063	10,789,091	2.9
		<u>22,581,577</u>	<u>6.1</u>
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Galaxy Entertainment Group Ltd.	1,276,000	8,485,642	2.3
Tongcheng Travel Holdings Ltd.	2,153,600	4,269,118	1.2
		<u>12,754,760</u>	<u>3.5</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai - Class A (Nth SZ-SEHK)	1,034,008	5,284,713	1.5
Midea Group Co., Ltd. - Class A	575,700	4,345,594	1.2
TCL Technology Group Corp. - Class A	3,067,500	1,959,711	0.5
		<u>11,590,018</u>	<u>3.2</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd.	1,802,900	19,867,869	5.4
PDD Holdings, Inc. (ADR)	87,170	7,647,424	2.1
Trip.com Group Ltd.	115,000	4,067,063	1.1
		<u>31,582,356</u>	<u>8.6</u>
MULTILINE-EINZELHANDEL			
Matahari Department Store Tbk PT	1,392,500	472,537	0.1
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Mobile World Investment Corp.	1,288,100	2,168,519	0.6
Topsports International Holdings Ltd.	2,137,000	1,864,913	0.5
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	1,008,500	5,030,037	1.4
		<u>9,063,469</u>	<u>2.5</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Samsonite International SA	2,592,300	7,265,600	2.0
		<u>95,310,317</u>	<u>26.0</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank of the Philippine Islands	2,048,400	4,063,493	1.1
BOC Hong Kong Holdings Ltd.	1,687,500	5,707,841	1.6
China Merchants Bank Co., Ltd. - Class H	1,258,000	6,811,349	1.9
CTBC Financial Holding Co., Ltd.	3,497,000	2,611,029	0.7
Dah Sing Financial Holdings Ltd.	122,600	331,123	0.1
Hana Financial Group, Inc.	231,340	7,937,152	2.2
KB Financial Group, Inc.	379,030	14,694,305	4.0
Metropolitan Bank & Trust Co.	2,882,780	3,031,216	0.8
Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd.	401,600	3,773,423	1.0
Ping An Bank Co., Ltd. - Class A	1,947,800	3,862,052	1.1
State Bank of India	1,340,421	8,471,321	2.3
United Overseas Bank Ltd.	157,500	3,494,679	0.9
		<u>64,788,983</u>	<u>17.7</u>
VERSICHERUNGEN			
Hyundai Marine & Fire Insurance Co., Ltd.	171,300	4,556,780	1.2
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	1,325,500	9,000,580	2.5
Ping An Insurance Group Co., of China Ltd. - Class A	661,300	4,586,381	1.2
		<u>18,143,741</u>	<u>4.9</u>
		<u>82,932,724</u>	<u>22.6</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
BOE Technology Group Co., Ltd. - Class A	15,432,000	9,259,400	2.5
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
FPT Corp.	1,244,420	4,216,154	1.2
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Nanya Technology Corp.	2,031,000	3,892,758	1.1
Novatek Microelectronics Corp.	327,000	4,373,308	1.2
Realtek Semiconductor Corp.	691,000	8,617,798	2.3
SK Hynix, Inc.	186,430	12,595,384	3.4
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	1,241,000	20,812,649	5.7
United Microelectronics Corp.	5,563,000	9,119,672	2.5
		<u>59,411,569</u>	<u>16.2</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Samsung Electronics Co., Ltd.	83,870	\$ 3,840,938	1.0%
		<u>76,728,061</u>	<u>20.9</u>
VERSORGUNG			
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE			
Power Grid Corp. of India Ltd.	1,405,192	3,773,582	1.0
GASVERSORGUNGSBETRIEBE			
China Resources Gas Group Ltd.	448,600	1,891,694	0.5
GAIL India Ltd.	5,138,299	6,371,012	1.8
Indraprastha Gas Ltd.	525,662	2,787,040	0.8
Kunlun Energy Co., Ltd.	7,440,000	5,952,455	1.6
		<u>17,002,201</u>	<u>4.7</u>
UNABHÄNGIGE STROM- UND ERNEUERBARE ELEKTRIZITÄTSPRODUZENTEN			
ACEN Corp.	436,080	49,950	0.0
China Datang Corp. Renewable Power Co., Ltd. - Class H	14,597,000	5,076,797	1.4
China Longyuan Power Group Corp., Ltd. - Class H	5,712,000	7,007,741	1.9
		<u>12,134,488</u>	<u>3.3</u>
		<u>32,910,271</u>	<u>9.0</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Ganfeng Lithium Co., Ltd. - Class H	676,680	4,715,570	1.3
Tianqi Lithium Corp. - Class A	193,600	2,283,972	0.6
		<u>6,999,542</u>	<u>1.9</u>
BAUMATERIAL			
Anhui Conch Cement Co., Ltd. - Class H	483,000	1,772,161	0.5
METALL UND BERGBAU			
Aluminum Corp. of China Ltd. - Class H	6,226,000	3,172,727	0.9
Zijin Mining Group Co., Ltd. - Class H	4,454,000	6,718,394	1.8
		<u>9,891,121</u>	<u>2.7</u>
		<u>18,662,824</u>	<u>5.1</u>
IMMOBILIEN			
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)			
Frasers Centrepont Trust	1,152,100	1,922,374	0.6
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG			
Ayala Land, Inc.	8,308,700	4,278,192	1.2
China Resources Land Ltd.	660,000	2,926,084	0.8
Megaworld Corp.	31,599,000	1,153,207	0.3
Vincom Retail JSC	2,206,100	2,479,077	0.7
Vinhomes JSC	1,543,200	2,695,404	0.7
Wharf Real Estate Investment Co., Ltd.	489,000	2,678,803	0.7
		<u>16,210,767</u>	<u>4.4</u>
		<u>18,133,141</u>	<u>5.0</u>
ENERGIE			
ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE			
China Oilfield Services Ltd. - Class H	5,358,000	5,733,840	1.6
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
China Petroleum & Chemical Corp. - Class H	18,856,000	9,632,909	2.6
		<u>15,366,749</u>	<u>4.2</u>
INDUSTRIEGÜTER			
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Ming Yang Smart Energy Group Ltd. - Class A	599,300	2,189,433	0.6
NARI Technology Co., Ltd. - Class A	1,542,041	5,824,381	1.6
		<u>8,013,814</u>	<u>2.2</u>
INDUSTRIEKONZERNE			
Ayala Corp.	143,410	1,619,354	0.4
MASCHINEN			
Weichai Power Co., Ltd. - Class H	283,000	419,665	0.1
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
BOC Aviation Ltd.	501,800	3,624,743	1.0
		<u>13,677,576</u>	<u>3.7</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
UNTERHALTUNG			
International Games System Co., Ltd.	140,000	2,320,353	0.6
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Tencent Holdings Ltd.	85,900	3,760,190	1.0

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
MEDIEN					
Media Nusantara Citra Tbk PT			4,518,100	\$ 192,575	0.1%
				<u>6,273,118</u>	<u>1.7</u>
				<u>359,994,781</u>	<u>98.2</u>
AKTIENANLEIHEN					
IMMOBILIEN					
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG					
Vincome Retail Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2023			1,449,760	<u>1,630,522</u>	<u>0.5</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
IT-DIENSTLEISTUNGEN					
FPT Corp. Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2023			349,028	<u>1,183,519</u>	<u>0.3</u>
				<u>2,814,041</u>	<u>0.8</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$373,644,604)				\$ <u>362,808,822</u>	<u>99.0%</u>
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	2.09 %	–		532	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	1.53 %	–		1	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	4.10 %	–		46	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.74 %	–		1,210,424	0.3
Citibank, New York(b)	3.93 %	–		4,389,890	1.2
HSBC, Singapore(b)	2.56 %	–		37,775	0.0
Scotiabank, Toronto(b)	3.33 %	–		732	0.0
SMBC, London(b)	2.92 %	–		29	0.0
Standard Chartered Bank, Johannesburg(b)	5.62 %	–		<u>3,856</u>	<u>0.0</u>
Termineinlagen insgesamt				<u>5,643,285</u>	<u>1.5</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>(1,869,960)</u>	<u>(0.5)</u>
Nettovermögen				\$ <u>366,582,147</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	89	USD 13	03/06/2023 \$ (46)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	13	CNH 89	03/06/2023 (356)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	95	USD 14	03/08/2023 371
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	13	CNH 89	03/08/2023 47
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	14	CNH 95	03/08/2023 (371)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD	1,054	USD 719	03/24/2023 9,496
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD	149	USD 110	03/24/2023 869
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	9	USD 10	03/24/2023 24
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	70	USD 85	03/24/2023 56
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD	171	USD 106	03/24/2023 781
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD	1	USD 1	03/24/2023 5
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	0*	AUD 1	03/24/2023 0
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	23,777	AUD 34,860	03/24/2023 (299,599)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	4,026	CAD 5,456	03/24/2023 (27,244)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	402	EUR 378	03/24/2023 (2,496)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	762	GBP 638	03/24/2023 5,147
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	4,142	GBP 3,425	03/24/2023 (21,346)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	4,349	NZD 6,974	03/24/2023 (36,837)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	47	SGD 64	03/24/2023 (329)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	10,395	ZAR 189,864	03/24/2023 (77,329)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR	5,293	USD 290	03/24/2023 2,101
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR	69	USD 4	03/24/2023 (12)
				<u>\$ (447,068)</u>
				Wertsteigerung \$ 18,897
				Wertminderung \$ (465,965)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

* Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

(a) Stellt sämtliche oder einen Teil der verliehenen Wertpapiere dar. Informationen zur Wertpapierleihe finden Sie in Anmerkung N.

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
CAD – Canadian Dollar
CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
NZD – New Zealand Dollar
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar
ZAR – South African Rand

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt
JSC – Joint Stock Company
REIT – Real Estate Investment Trust

	Anteile	Wert (JPY)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFRACHT UND LOGISTIK			
Sankyu, Inc.	8,000	¥ 40,080,000	0.6%
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Park24 Co., Ltd.	72,800	145,163,200	2.3
INDUSTRIEKONZERNE			
Hitachi Ltd.	26,800	184,652,000	3.0
MASCHINEN			
Amada Co., Ltd.	82,800	102,589,200	1.6
Glory Ltd.	9,600	26,592,000	0.4
IHI Corp.	18,700	66,104,500	1.1
Toyota Industries Corp.	14,600	116,654,000	1.9
		<u>311,939,700</u>	<u>5.0</u>
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Dip Corp.	27,900	98,208,000	1.6
Outsourcing, Inc.	68,100	89,892,000	1.4
UT Group Co., Ltd.	48,500	120,280,000	1.9
		<u>308,380,000</u>	<u>4.9</u>
STRASSE UND SCHIENE			
East Japan Railway Co. (a)	15,800	109,114,800	1.7
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
Mitsubishi Corp.	32,800	151,831,200	2.4
		<u>1,251,160,900</u>	<u>19.9</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Sumitomo Electric Industries Ltd.	79,300	132,867,150	2.1
TS Tech Co., Ltd.	39,300	67,871,100	1.1
		<u>200,738,250</u>	<u>3.2</u>
KRAFTFAHRZEUGE			
Honda Motor Co., Ltd.	43,700	154,785,400	2.5
Suzuki Motor Corp.	36,900	176,492,700	2.8
Toyota Motor Corp. (a)	54,900	102,251,250	1.6
		<u>433,529,350</u>	<u>6.9</u>
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Food & Life Cos. Ltd.	21,100	72,795,000	1.2
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Sony Group Corp.	21,100	241,173,000	3.8
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
ASKUL Corp.	76,700	132,077,400	2.1
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
ABC-Mart, Inc.	10,600	71,126,000	1.1
Shimamura Co., Ltd.	2,700	34,344,000	0.6
		<u>105,470,000</u>	<u>1.7</u>
		<u>1,185,783,000</u>	<u>18.9</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSTRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Oki Electric Industry Co., Ltd. (a)	119,900	85,248,900	1.4
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
BIPROGY, Inc.	46,400	140,128,000	2.3
NEC Networks & System Integration Corp.	79,200	132,264,000	2.1
Otsuka Corp.	29,100	133,569,000	2.1
		<u>405,961,000</u>	<u>6.5</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Oporun Co., Ltd.	24,500	54,586,000	0.8
Rorze Corp. (a)	6,000	63,540,000	1.0
SCREEN Holdings Co., Ltd. (a)	11,400	123,918,000	2.0
		<u>242,044,000</u>	<u>3.8</u>
		<u>733,253,900</u>	<u>11.7</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	82,400	79,524,240	1.2
Resona Holdings, Inc. (a)	249,500	187,100,050	3.0
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	47,000	280,684,000	4.5
		<u>547,308,290</u>	<u>8.7</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (JPY)	Nettover- mögen %
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN					
ORIX Corp.			50,800	¥ 124,028,200	2.0%
				<u>671,336,490</u>	<u>10.7</u>
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
Air Water, Inc.			58,200	95,273,400	1.5
Tosoh Corp.			99,200	183,718,400	2.9
Zeon Corp. (a)			113,500	146,188,000	2.4
				<u>425,179,800</u>	<u>6.8</u>
CONTAINER UND VERPACKUNGEN					
Rengo Co., Ltd.			197,600	174,678,400	2.8
METALL UND BERGBAU					
Sumitomo Metal Mining Co., Ltd. (a)			13,800	69,828,000	1.1
				<u>669,686,200</u>	<u>10.7</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE					
Nippon Telegraph & Telephone Corp.			80,100	316,154,700	5.0
UNTERHALTUNG					
Konami Holdings Corp. (a)			26,600	159,866,000	2.5
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN					
Kakaku.com, Inc.			29,800	60,553,600	1.0
MEDIEN					
Kadokawa Corp. (a)			28,000	76,020,000	1.2
				<u>612,594,300</u>	<u>9.7</u>
VERBRAUCHSGÜTER					
GETRÄNKE					
Asahi Group Holdings Ltd.			19,136	92,158,976	1.5
Kirin Holdings Co., Ltd.			40,200	81,967,800	1.3
				<u>174,126,776</u>	<u>2.8</u>
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL					
Sundrug Co., Ltd.			22,800	84,018,000	1.3
LEBENSMITTELPRODUKTE					
Nichirei Corp.			44,400	119,347,200	1.9
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE					
Pola Orbis Holdings, Inc.			62,400	108,326,400	1.7
				<u>485,818,376</u>	<u>7.7</u>
IMMOBILIEN					
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG					
Daito Trust Construction Co., Ltd.			5,700	73,131,000	1.2
Mitsui Fudosan Co., Ltd.			67,900	176,200,500	2.8
				<u>249,331,500</u>	<u>4.0</u>
GESUNDHEITSWESEN					
PHARMAZEUTIKA					
Nippon Shinyaku Co., Ltd.			22,100	134,810,000	2.2
Santen Pharmaceutical Co., Ltd.			63,000	65,520,000	1.0
				<u>200,330,000</u>	<u>3.2</u>
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
ENEOS Holdings, Inc.			391,800	184,263,540	2.9
Gesamtanlagen					
(Kosten ¥5,997,827,366)				¥ 6,243,558,206	99.4%
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	2.09 %	–		36,375	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	1.53 %	–		120	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	2.56 %	–		3	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	4.10 %	–		22,518	0.0
Scotiabank, Toronto(b)	3.93 %	–		2,493,021	0.1
SEB, Stockholm(b)	(0.56)%	–		93,863,421	1.5
Standard Chartered Bank, Johannesburg(b)	5.62 %	–		211,352	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>96,626,810</u>	<u>1.6</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>(61,339,088)</u>	<u>(1.0)</u>
Nettovermögen				<u>¥ 6,278,845,928</u>	<u>100.0%</u>

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	AUD	4	JPY	368	03/24/2023	¥ 830
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CZK	4	JPY	27	03/24/2023	(433)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR	9	JPY	1,243	03/24/2023	(10,277)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	354,949	AUD	3,878	03/24/2023	(533,886)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	2,547	CZK	422	03/24/2023	30,060
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	119,432	EUR	835	03/24/2023	591,926
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	50,011	NZD	598	03/24/2023	134,119
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	2,090	SGD	21	03/24/2023	9,207
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	659,399	USD	4,913	03/24/2023	7,439,334
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	35,801	ZAR	4,856	03/24/2023	12,328
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	NZD	2	JPY	187	03/24/2023	(512)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD	0*	JPY	22	03/24/2023	(127)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	42	JPY	5,653	03/24/2023	(58,327)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	2	JPY	219	03/24/2023	379
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR	63	JPY	463	03/24/2023	(359)
						¥ 7,614,262
					Wertsteigerung	¥ 8,218,183
					Wertminderung	¥ (603,921)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

* Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500

(a) Stellt sämtliche oder einen Teil der verliehenen Wertpapiere dar. Informationen zur Wertpapierleihe finden Sie in Anmerkung N.

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar

CZK – Czech Koruna

EUR – Euro

JPY – Japanese Yen

NZD – New Zealand Dollar

SGD – Singapore Dollar

USD – United States Dollar

ZAR – South African Rand

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KRAFTFAHRZEUGE			
Guangzhou Automobile Group Co., Ltd. - Class H	1,790,000	\$ 1,140,215	0.9%
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Jiumaojiu International Holdings Ltd. (a)	966,000	2,328,423	1.9
Tongcheng Travel Holdings Ltd.	1,324,000	2,624,588	2.1
		<u>4,953,011</u>	<u>4.0</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai - Class A (Nth SZ-SEHK)	267,300	1,366,144	1.1
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd.	931,660	10,266,847	8.3
JD.com, Inc. - Class A	109,126	2,414,858	2.0
Meituan - Class B	181,370	3,144,757	2.6
PDD Holdings, Inc. (ADR)	45,050	3,952,236	3.2
Trip.com Group Ltd.	70,750	2,502,128	2.0
		<u>22,280,826</u>	<u>18.1</u>
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Topsports International Holdings Ltd.	1,262,000	1,101,320	0.9
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	247,500	1,234,441	1.0
		<u>2,335,761</u>	<u>1.9</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Bosideng International Holdings Ltd.	3,144,000	1,742,350	1.4
Li Ning Co., Ltd.	285,500	2,427,845	2.0
Samsonite International SA	754,800	2,115,525	1.7
Shenzhou International Group Holdings Ltd.	76,400	834,137	0.7
Stella International Holdings Ltd.	1,825,000	1,773,989	1.4
		<u>8,893,846</u>	<u>7.2</u>
		<u>40,969,803</u>	<u>33.2</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
BOC Hong Kong Holdings Ltd.	369,500	1,249,806	1.0
China Construction Bank Corp. - Class H	5,151,100	3,149,958	2.5
China Merchants Bank Co., Ltd. - Class H	678,000	3,670,981	3.0
		<u>8,070,745</u>	<u>6.5</u>
KAPITALMÄRKTE			
CITIC Securities Co., Ltd. - Class H	547,400	1,159,042	0.9
VERSICHERUNGEN			
China Life Insurance Co., Ltd. - Class H	795,000	1,347,046	1.1
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	631,000	4,284,697	3.5
		<u>5,631,743</u>	<u>4.6</u>
		<u>14,861,530</u>	<u>12.0</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
UNTERHALTUNG			
NetEase, Inc.	61,000	941,104	0.7
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Tencent Holdings Ltd.	264,600	11,582,612	9.4
		<u>12,523,716</u>	<u>10.1</u>
INDUSTRIEGÜTER			
BAU- UND INGENIEURWESEN			
China State Construction Engineering Corp., Ltd. - Class A	1,605,800	1,298,531	1.1
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. - Class A	20,600	1,197,197	0.9
Ming Yang Smart Energy Group Ltd. - Class A	402,400	1,470,094	1.2
NARI Technology Co., Ltd. - Class A	777,875	2,938,081	2.4
		<u>5,605,372</u>	<u>4.5</u>
INDUSTRIEKONZERNE			
Guoco Group Ltd.	91,000	823,120	0.7
MASCHINEN			
Weichai Power Co., Ltd. - Class H	710,000	1,052,870	0.8
XCMG Construction Machinery Co., Ltd. - Class A	1,189,400	1,215,097	1.0
		<u>2,267,967</u>	<u>1.8</u>
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
BOC Aviation Ltd. (a)	166,100	1,199,821	1.0
		<u>11,194,811</u>	<u>9.1</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
China Resources Beer Holdings Co., Ltd.	284,000	\$ 2,096,696	1.7%
Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co., Ltd. - Class A	41,800	1,022,528	0.8
Kweichow Moutai Co., Ltd. - Class A	10,000	2,609,754	2.1
Tsingtao Brewery Co., Ltd. - Class H	254,000	2,504,599	2.0
Wuliangye Yibin Co., Ltd. - Class A	43,600	<u>1,282,432</u>	<u>1.1</u>
		<u>9,516,009</u>	<u>7.7</u>
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Taiwan FamilyMart Co., Ltd./Taiwan	171,000	<u>1,139,271</u>	<u>0.9</u>
		<u>10,655,280</u>	<u>8.6</u>
VERSORGUNG			
GASVERSORGUNGSBETRIEBE			
China Resources Gas Group Ltd.	309,500	1,305,125	1.0
Kunlun Energy Co., Ltd.	3,670,000	<u>2,936,225</u>	<u>2.4</u>
		<u>4,241,350</u>	<u>3.4</u>
UNABHÄNGIGE STROM- UND ERNEUERBARE ELEKTRIZITÄTSPRODUZENTEN			
China Datang Corp. Renewable Power Co., Ltd. - Class H	4,010,000	1,394,667	1.2
China Longyuan Power Group Corp., Ltd. - Class H	1,132,000	<u>1,388,789</u>	<u>1.1</u>
		<u>2,783,456</u>	<u>2.3</u>
		<u>7,024,806</u>	<u>5.7</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSTRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
BOE Technology Group Co., Ltd. - Class A	3,890,900	<u>2,334,590</u>	<u>1.9</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSTRÜSTUNG			
JA Solar Technology Co., Ltd. - Class A	122,800	1,079,957	0.9
Realtek Semiconductor Corp.	91,000	1,134,905	0.9
Will Semiconductor Co., Ltd. Shanghai Class A	78,200	<u>967,113</u>	<u>0.8</u>
		<u>3,181,975</u>	<u>2.6</u>
		<u>5,516,565</u>	<u>4.5</u>
GESUNDHEITSWESEN			
GESUNDHEITSWESEN – AUSTRÜSTUNG UND BEDARF			
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co., Ltd. - Class A	33,200	<u>1,500,099</u>	<u>1.2</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co., Ltd. - Class H	616,100	<u>1,086,303</u>	<u>0.9</u>
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
WuXi AppTec Co., Ltd. Class H	131,500	<u>1,399,702</u>	<u>1.1</u>
PHARMAZEUTIKA			
Sichuan Kelun Pharmaceutical Co., Ltd. - Class A	159,275	<u>661,636</u>	<u>0.6</u>
		<u>4,647,740</u>	<u>3.8</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Ganfeng Lithium Co., Ltd. - Class H	122,000	850,180	0.7
Suzhou TA&A Ultra Clean Technology Co., Ltd.	156,900	<u>1,298,121</u>	<u>1.1</u>
		<u>2,148,301</u>	<u>1.8</u>
METALL UND BERGBAU			
Aluminum Corp. of China Ltd. - Class H	1,706,000	869,366	0.7
Zijin Mining Group Co., Ltd. - Class H	916,000	<u>1,381,690</u>	<u>1.1</u>
		<u>2,251,056</u>	<u>1.8</u>
		<u>4,399,357</u>	<u>3.6</u>
IMMOBILIEN			
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG			
China Resources Land Ltd.	292,000	1,294,570	1.1
Hang Lung Properties Ltd.	527,000	<u>1,016,483</u>	<u>0.8</u>
		<u>2,311,053</u>	<u>1.9</u>
ENERGIE			
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
China Petroleum & Chemical Corp. - Class H	3,814,000	<u>1,948,447</u>	<u>1.6</u>
		<u>116,053,108</u>	<u>94.1</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
ENERGIE			
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
PetroChina Co., Ltd. - Class H	6,398,000	<u>3,276,678</u>	<u>2.6</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettovermögen %
Gesamtanlagen					
(Kosten \$127,580,852).....				\$ 119,329,786	96.7%
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	2.09 %	–		1,091	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	2.56 %	–		1	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	3.33 %	–		1	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	4.10 %	–		657	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.74 %	–		459,959	0.4
HSBC, Paris(b)	1.53 %	–		14,035	0.0
JPMorgan Chase, New York(b)	3.93 %	–		6,585,250	5.4
Standard Chartered Bank, Johannesburg(b).....	5.62 %	–		18,330	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	(0.56)%	–		11,967	0.0
Termineinlagen insgesamt				7,091,291	5.8
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				(3,055,348)	(2.5)
Nettovermögen				\$ 123,365,729	100.0%

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 514	USD 351	03/24/2023	\$ 4,614
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 305	USD 205	03/24/2023	(474)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 51	USD 38	03/24/2023	244
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 11	USD 12	03/24/2023	19
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 13	USD 15	03/24/2023	10
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 12	USD 15	03/24/2023	(14)
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 51	USD 32	03/24/2023	235
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 36	USD 22	03/24/2023	(106)
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 95	USD 21	03/24/2023	(55)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 4	USD 3	03/24/2023	7
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 0*	AUD 0*	03/24/2023	0
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 10,405	AUD 15,255	03/24/2023	(131,106)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 738	CAD 999	03/24/2023	(4,991)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 10	EUR 10	03/24/2023	28
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 262	EUR 246	03/24/2023	(1,626)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 764	GBP 632	03/24/2023	(3,944)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,115	NZD 1,789	03/24/2023	(9,448)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 553	PLN 2,467	03/24/2023	603
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 64	SGD 86	03/24/2023	(443)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 4	ZAR 72	03/24/2023	13
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 15,083	ZAR 275,485	03/24/2023	(112,199)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 9,377	USD 514	03/24/2023	3,990
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 5,452	USD 295	03/24/2023	(948)
				\$ (255,591)
			Wertsteigerung	\$ 9,763
			Wertminderung	\$ (265,354)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

* Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

(a) Stellt sämtliche oder einen Teil der verliehenen Wertpapiere dar. Informationen zur Wertpapierleihe finden Sie in Anmerkung N.

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD	– Australian Dollar
CAD	– Canadian Dollar
EUR	– Euro
GBP	– Great British Pound
NZD	– New Zealand Dollar
PLN	– Polish Zloty
SGD	– Singapore Dollar
USD	– United States Dollar
ZAR	– South African Rand

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
KANADA					
Canadian Government Bond	2.75%	08/01/2024	CAD 6,732	\$ 4,822,919	1.0%
Canadian Government Bond	3.75%	02/01/2025	13,544	9,842,376	2.0
				<u>14,665,295</u>	<u>3.0</u>
FRANKREICH					
French Republic Government Bond OAT	4.25%	10/25/2023	EUR 17,878	19,039,167	3.9
ITALIEN					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series 3Y	3.50%	01/15/2026	4,587	4,814,397	1.0
JAPAN					
Japan Government Twenty Year Bond, Series 65	1.90%	12/20/2023	JPY 1,184,600	8,839,176	1.8
Japan Government Twenty Year Bond, Series 69	2.10%	03/20/2024	2,899,350	21,774,000	4.5
				<u>30,613,176</u>	<u>6.3</u>
MEXIKO					
Mexican Bonos	5.50%	03/04/2027	MXN 188,489	8,785,804	1.8
Mexican Bonos, Series M	5.00%	03/06/2025	49,530	2,410,244	0.5
Mexican Bonos, Series M	5.75%	03/05/2026	117,147	5,645,107	1.2
				<u>16,841,155</u>	<u>3.5</u>
NEUSEELAND					
New Zealand Government Bond, Series 425	2.75%	04/15/2025	NZD 13,145	7,772,080	1.6
PERU					
Peru Government Bond	8.20%	08/12/2026	PEN 15,216	4,157,352	0.9
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Bonds	7.50%	11/15/2024	USD 39,524	41,154,365	8.5
U.S. Treasury Bonds	7.63%	02/15/2025	35,895	37,706,577	7.8
U.S. Treasury Notes	2.88%	11/30/2023	13,088	12,871,132	2.7
U.S. Treasury Notes	4.25%	09/30/2024	14,699	14,533,062	3.0
U.S. Treasury Notes(a)	4.38%	10/31/2024	20,787	20,588,677	4.2
				<u>126,853,813</u>	<u>26.2</u>
				<u>224,756,435</u>	<u>46.4</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
ABN AMRO Bank NV	3.63%	01/10/2026	EUR 400	420,087	0.1
AIB Group PLC	7.58%	10/14/2026	USD 1,276	1,308,388	0.3
Banco Santander SA	3.75%	01/16/2026	EUR 1,900	1,987,373	0.4
Bank of America Corp.	1.84%	02/04/2025	USD 2,124	2,047,264	0.4
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4.94%	01/26/2026	1,444	1,421,702	0.3
Barclays PLC	0.75%	06/09/2025	EUR 551	556,875	0.1
Barclays PLC	2.89%	01/31/2027	1,008	1,012,954	0.2
Barclays PLC	3.38%	04/02/2025	620	649,835	0.1
BPCE SA	0.63%	04/28/2025	2,000	1,969,578	0.4
Citigroup, Inc.	2.01%	01/25/2026	USD 1,532	1,429,766	0.3
Citigroup, Inc.(b)	5.96%	03/17/2026	549	552,987	0.1
Credit Agricole SA	4.00%	10/12/2026	EUR 2,000	2,097,966	0.4
Danske Bank A/S	0.97%	09/10/2025	USD 1,009	934,664	0.2
Danske Bank A/S	3.77%	03/28/2025	945	924,413	0.2
Deutsche Bank AG	3.88%	02/12/2024	GBP 1,100	1,298,202	0.3
Dnb Bank ASA	4.00%	08/17/2027	1,455	1,666,145	0.4
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	1.75%	01/24/2025	USD 2,135	2,054,455	0.4
HSBC Holdings PLC	1.64%	04/18/2026	2,170	1,989,852	0.4
Intesa Sanpaolo SpA	5.25%	01/12/2024	1,512	1,505,242	0.3
JPMorgan Chase & Co.	0.99%	04/28/2026	GBP 1,796	1,967,822	0.4
Lloyds Banking Group PLC	3.50%	04/01/2026	EUR 1,356	1,412,091	0.3
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	2.26%	06/14/2025	1,897	1,953,015	0.4
Morgan Stanley	2.10%	05/08/2026	1,964	1,982,232	0.4
NatWest Markets PLC	0.13%	11/12/2025	2,127	2,016,619	0.4
Santander UK Group Holdings PLC	3.63%	01/14/2026	GBP 1,366	1,553,796	0.3
Societe Generale SA(b)	5.59%	01/21/2026	USD 463	457,773	0.1
Standard Chartered PLC	2.82%	01/30/2026	1,576	1,486,072	0.3
Standard Chartered PLC	6.17%	01/09/2027	257	259,612	0.1
Swedbank AB	3.75%	11/14/2025	EUR 1,764	1,853,517	0.4
UBS Group AG	0.25%	01/29/2026	604	591,463	0.1
UBS Group AG	1.00%	07/30/2024	USD 444	435,475	0.1
				<u>41,797,235</u>	<u>8.6</u>
MAKLER					
Charles Schwab Corp. (The)(b)	5.10%	05/13/2026	2,083	2,049,637	0.4
Nomura Holdings, Inc.	5.71%	01/09/2026	749	747,899	0.2
				<u>2,797,536</u>	<u>0.6</u>

AB FCP I
Short Duration Bond Portfolio

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
FINANZEN					
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	USD 1,214	\$ 1,187,397	0.3%
Aviation Capital Group LLC	4.38%	01/30/2024	778	763,842	0.2
Aviation Capital Group LLC	5.50%	12/15/2024	497	490,786	0.1
JAB Holdings BV	1.25%	05/22/2024	EUR 2,100	2,154,322	0.4
Synchrony Financial	4.50%	07/23/2025	USD 1,229	1,183,588	0.2
				<u>5,779,935</u>	<u>1.2</u>
VERSICHERUNGEN					
Berkshire Hathaway, Inc.	0.00%	03/12/2025	EUR 2,171	2,128,481	0.4
Metropolitan Life Global Funding I	1.75%	05/25/2025	1,945	1,965,795	0.4
New York Life Global Funding(b)	4.85%	06/09/2026	USD 1,718	1,668,237	0.4
				<u>5,762,513</u>	<u>1.2</u>
REITs					
Heimstaden Bostad Treasury BV	0.25%	10/13/2024	EUR 541	518,041	0.1
Omega Healthcare Investors, Inc.	4.95%	04/01/2024	USD 1,265	1,244,996	0.2
				<u>1,763,037</u>	<u>0.3</u>
				<u>57,900,256</u>	<u>11.9</u>
INDUSTRIE					
INVESTITIONSGÜTER					
Johnson Controls International PLC	1.00%	09/15/2023	EUR 1,791	1,867,187	0.4
Parker-Hannifin Corp.	1.13%	03/01/2025	2,133	2,134,150	0.4
				<u>4,001,337</u>	<u>0.8</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.35%	06/08/2025	USD 1,599	1,525,529	0.3
Toyota Motor Credit Corp.	0.63%	11/21/2024	EUR 676	677,319	0.1
Toyota Motor Finance Netherlands BV	0.00%	10/27/2025	429	411,207	0.1
Toyota Motor Finance Netherlands BV	3.38%	01/13/2026	823	860,643	0.2
Volkswagen Financial Services AG	0.25%	01/31/2025	990	977,108	0.2
Volkswagen Leasing GmbH.	1.13%	04/04/2024	931	956,044	0.2
				<u>5,407,850</u>	<u>1.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
VF Corp.	4.13%	03/07/2026	542	571,412	0.1
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
American Medical Systems Europe BV	0.75%	03/08/2025	1,695	1,682,533	0.4
Asahi Group Holdings Ltd.	0.16%	10/23/2024	2,010	1,995,447	0.4
Baxter International, Inc.	1.30%	05/30/2025	690	686,491	0.1
Becton Dickinson and Co.	0.00%	08/13/2023	752	783,186	0.2
Becton Dickinson and Co.	0.03%	08/13/2025	551	529,364	0.1
DH Europe Finance II SARL.	0.20%	03/18/2026	2,219	2,102,947	0.4
GSK Consumer Healthcare Capital NL BV.	1.25%	03/29/2026	353	343,499	0.1
Medtronic Global Holdings SCA.	0.00%	10/15/2025	1,862	1,791,182	0.4
				<u>9,914,649</u>	<u>2.1</u>
ENERGIE					
BP Capital Markets PLC	1.88%	04/07/2024	2,060	2,136,455	0.5
Exxon Mobil Corp.	0.14%	06/26/2024	2,095	2,114,958	0.4
Repsol International Finance BV.	0.13%	10/05/2024	1,500	1,497,082	0.3
				<u>5,748,495</u>	<u>1.2</u>
TECHNOLOGIE					
Fidelity National Information Services, Inc.	0.63%	12/03/2025	1,610	1,554,053	0.3
Fiserv, Inc.	0.38%	07/01/2023	1,255	1,315,226	0.3
Honeywell International, Inc.	0.00%	03/10/2024	1,877	1,909,720	0.4
				<u>4,778,999</u>	<u>1.0</u>
				<u>30,422,742</u>	<u>6.3</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Electricite de France SA.	4.63%	09/11/2024	1,650	1,766,444	0.4
Enel Finance International NV	6.80%	10/14/2025	USD 1,227	1,257,030	0.3
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	6.05%	03/01/2025	256	257,706	0.1
Scottish Power UK PLC	6.75%	05/29/2023	GBP 1,040	1,255,263	0.2
Vattenfall AB	3.25%	04/18/2024	EUR 1,165	1,223,956	0.2
				<u>5,760,399</u>	<u>1.2</u>
ERDGAS					
Southern Gas Networks PLC.	4.88%	10/05/2023	GBP 1,185	1,423,049	0.3
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE					
Thames Water Utilities Finance PLC.	1.88%	01/24/2024	1,654	1,930,878	0.4
				<u>9,114,326</u>	<u>1.9</u>
				<u>97,437,324</u>	<u>20.1</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
GEDECKTE ANLEIHEN					
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	0.25%	03/17/2025	EUR 1,343	\$ 1,321,141	0.3%
Bank of Montreal	1.00%	04/05/2026	2,413	2,347,282	0.5
Bank of Nova Scotia (The)	0.01%	03/18/2025	2,369	2,317,971	0.5
Bank of Nova Scotia (The)	0.45%	03/16/2026	320	306,072	0.1
BPCE SFH SA	0.13%	03/31/2025	300	294,706	0.1
BPCE SFH SA	0.75%	09/02/2025	1,500	1,476,342	0.3
Caisse Francaise de Financement Local	0.01%	05/07/2025	2,400	2,345,345	0.5
CaixaBank SA	2.63%	03/21/2024	500	522,539	0.1
Cie de Financement Foncier SA	0.75%	05/29/2026	2,600	2,512,384	0.5
Commonwealth Bank of Australia	0.38%	04/11/2024	1,932	1,969,458	0.4
Commonwealth Bank of Australia	0.50%	07/27/2026	704	667,355	0.1
Credit Agricole Home Loan SFH SA	0.38%	09/30/2024	400	402,045	0.1
Credit Agricole Home Loan SFH SA	3.25%	09/28/2026	1,200	1,258,283	0.3
Credit Agricole Home Loan SFH SA	4.00%	07/16/2025	650	692,380	0.1
Danske Mortgage Bank PLC	0.01%	11/24/2026	187	173,833	0.0
DNB Boligkredit AS	0.63%	06/19/2025	2,662	2,627,454	0.5
ING Bank NV	3.00%	02/15/2026	1,700	1,770,603	0.4
Korea Housing Finance Corp.	0.10%	06/18/2024	1,905	1,918,958	0.4
Lloyds Bank PLC	0.13%	06/18/2026	649	610,711	0.1
Lloyds Bank PLC	3.25%	02/02/2026	446	465,572	0.1
National Australia Bank Ltd.	0.63%	03/16/2027	410	383,165	0.1
National Australia Bank Ltd.	0.75%	01/30/2026	1,777	1,723,503	0.3
National Bank of Canada	0.38%	01/15/2024	292	300,345	0.1
National Bank of Canada	0.75%	03/13/2025	624	620,679	0.1
National Westminster Bank PLC	0.50%	05/15/2024	515	524,188	0.1
Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj	0.63%	05/23/2025	2,406	2,380,112	0.5
Royal Bank of Canada	0.63%	03/23/2026	2,409	2,318,649	0.5
Santander UK PLC	1.13%	03/12/2027	2,365	2,264,054	0.5
Skandinaviska Enskilda Banken AB	0.38%	02/09/2026	1,363	1,311,485	0.3
Skandinaviska Enskilda Banken AB, Series 580	1.00%	12/17/2025	SEK 14,000	1,236,782	0.2
Societe Generale SFH SA	3.00%	10/28/2025	EUR 2,100	2,186,928	0.4
Societe Generale SFH SA	3.13%	02/24/2026	1,200	1,253,900	0.2
Stadshypotek AB	0.38%	03/13/2026	367	352,244	0.1
Stadshypotek AB	0.50%	07/11/2025	2,247	2,207,574	0.4
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	3.60%	02/16/2026	455	476,870	0.1
Swedbank Hypotek AB	0.05%	05/28/2025	801	781,251	0.2
Westpac Banking Corp.	0.50%	05/17/2024	2,213	2,252,012	0.5
Westpac Banking Corp.	0.50%	01/16/2025	554	550,775	0.1
				<u>49,124,950</u>	<u>10.1</u>
INFLATIONSgebundene Wertpapiere					
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Inflation Index	0.13%	07/15/2024	USD 18,587	18,186,125	3.8
U.S. Treasury Inflation Index	0.13%	10/15/2026	8,763	8,272,707	1.7
				<u>26,458,832</u>	<u>5.5</u>
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
FRANKREICH					
Dexia Credit Local SA	1.25%	10/27/2025	EUR 3,700	3,683,834	0.7
Dexia Credit Local SA	2.13%	02/12/2025	GBP 4,200	4,803,397	1.0
				<u>8,487,231</u>	<u>1.7</u>
DEUTSCHLAND					
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	4.00%	02/27/2025	AUD 5,305	3,552,171	0.7
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	4.10%	02/20/2026	3,811	2,553,164	0.5
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	5.00%	03/19/2024	2,658	1,802,804	0.4
Landwirtschaftliche Rentenbank	0.00%	09/28/2026	EUR 1,754	1,650,686	0.4
				<u>9,558,825</u>	<u>2.0</u>
UNGARN					
Hungary Government International Bond	5.00%	02/22/2027	1,244	1,312,489	0.3
SÜDKOREA					
Korea International Bond	0.00%	10/15/2026	1,737	1,601,601	0.3
				<u>20,960,146</u>	<u>4.3</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – KOMMUNALANLEIHEN					
KANADA					
Province of Alberta Canada	0.63%	01/16/2026	2,255	2,196,844	0.5
Province of British Columbia Canada	2.50%	02/26/2027	AUD 1,461	899,120	0.2
Province of British Columbia Canada	4.25%	11/27/2024	4,670	3,124,468	0.6
Province of Ontario Canada	3.10%	08/26/2025	3,760	2,443,068	0.5
Province of Ontario Canada	4.25%	08/22/2024	3,560	2,387,762	0.5
Province of Ontario Canada, Series HP	8.10%	09/08/2023	CAD 2,150	1,603,814	0.3
Province of Quebec Canada	1.13%	10/28/2025	EUR 1,217	1,206,161	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %	
Province of Quebec Canada	4.20%	03/10/2025	AUD	5,448	\$ 3,646,882	0.8%
					<u>17,508,119</u>	<u>3.6</u>
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN						
KANADA						
Export Development Canada	0.25%	03/07/2026	EUR	273	262,216	0.1
JAPAN						
Development Bank of Japan, Inc.	0.01%	10/15/2024		2,485	2,470,833	0.5
Development Bank of Japan, Inc.	2.13%	09/01/2026		435	435,710	0.1
					<u>2,906,543</u>	<u>0.6</u>
NIEDERLANDE						
BNG Bank NV	3.25%	07/15/2025	AUD	3,765	2,462,126	0.5
BNG Bank NV	5.25%	05/20/2024		3,070	2,086,130	0.4
					<u>4,548,256</u>	<u>0.9</u>
NORWEGEN						
Kommunalbanken AS	1.00%	12/12/2024	GBP	2,200	2,476,374	0.5
					<u>10,193,389</u>	<u>2.1</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN						
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH						
Bellemeade Re Ltd.						
Series 2018-3A, Class M1B(b)	6.47%	10/25/2028	USD	32	32,333	0.0
Series 2019-3A, Class M1B(b)	6.21%	07/25/2029		27	27,256	0.0
Connecticut Avenue Securities Trust						
Series 2021-R01, Class 1M1(b)	5.23%	10/25/2041		23	23,249	0.0
Series 2021-R01, Class 1M2(b)	6.03%	10/25/2041		79	76,975	0.0
Series 2021-R03, Class 1M1(b)	5.33%	12/25/2041		470	464,787	0.1
Eagle Re Ltd.						
Series 2021-2, Class M1A(b)	6.03%	04/25/2034		127	126,691	0.0
Series 2021-2, Class M1B(b)	6.53%	04/25/2034		303	301,019	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes						
Series 2021-DNA5, Class M2(b)	6.13%	01/25/2034		257	255,137	0.1
Series 2021-DNA6, Class M1(b)	5.28%	10/25/2041		53	52,538	0.0
Series 2021-DNA6, Class M2(b)	5.98%	10/25/2041		812	780,267	0.2
Series 2021-HQA4, Class M1(b)	5.43%	12/25/2041		751	725,865	0.2
Series 2022-DNA3, Class M1A(b)	6.48%	04/25/2042		634	636,706	0.1
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities						
Series 2014-C04, Class 1M2(b)	9.52%	11/25/2024		611	636,108	0.1
Series 2014-C04, Class 2M2(b)	9.62%	11/25/2024		71	72,216	0.0
Series 2016-C02, Class 1M2(b)	10.61%	09/25/2028		322	338,160	0.1
Series 2016-C03, Class 1M2(b)	9.92%	10/25/2028		506	538,750	0.1
Home Re Ltd., Series 2019-1, Class M1(b)	6.26%	05/25/2029		690	690,198	0.1
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2019-2R, Class A(b)	7.26%	05/27/2023		392	386,642	0.1
Triangle Re Ltd., Series 2021-3, Class M1A(b)	6.38%	02/25/2034		578	574,872	0.1
					<u>6,739,769</u>	<u>1.4</u>
SUPRANATIONALE UNTERNEHMEN						
Nordic Investment Bank	0.50%	11/03/2025	EUR	2,248	2,197,760	0.4
Nordic Investment Bank	4.75%	02/28/2024	AUD	3,314	2,243,231	0.5
					<u>4,440,991</u>	<u>0.9</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN						
CLO – VARIABEL VERZINSLICH						
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2021-4A, Class A1(b)	5.97%	10/20/2034	USD	1,144	1,119,990	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 43 Ltd., Series 2021-43A, Class A(b)	5.92%	07/17/2035		1,672	1,646,683	0.4
New Mountain CLO 3 Ltd., Series CLO-3A, Class A(b)	5.98%	10/20/2034		1,018	995,104	0.2
					<u>3,761,777</u>	<u>0.8</u>
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE						
QUASI-STAATSANLEIHEN						
SÜDKOREA						
Export-Import Bank of Korea	0.83%	04/27/2025	EUR	1,265	1,254,312	0.2
Korea Development Bank (The)	0.00%	07/10/2024		504	502,762	0.1
Korea Development Bank (The)	1.50%	08/29/2024	AUD	2,000	1,275,398	0.3
					<u>3,032,472</u>	<u>0.6</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN						
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS						
MSCG Trust, Series 2018-SELF, Class A(b)	5.48%	10/15/2037	USD	1,263	1,253,084	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal National Mortgage Association, Series 1999	7.00%	09/01/2029	USD	0* \$ 371	0.0%
Federal National Mortgage Association, Series 1999	7.00%	10/01/2029	1	1,104	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2000	7.00%	12/01/2030	1	755	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	09/01/2031	7	7,442	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	11/01/2031	3	2,982	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	12/01/2031	6	5,806	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	01/01/2032	1	1,325	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2002	7.00%	02/01/2032	1	1,226	0.0
				<u>21,011</u>	<u>0.0</u>
				<u>465,688,299</u>	<u>96.1</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class A1(b)	5.96%	07/20/2034	1,646	1,624,002	0.4
Ballyrock CLO Ltd., Series 2021-16A, Class A1(b)	5.93%	07/20/2034	1,106	1,084,547	0.2
Black Diamond CLO Ltd., Series 2019-2A, Class A1A(b)	6.24%	07/23/2032	1,471	1,444,645	0.3
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 Ltd, Series 2021-42A, Class A(b)	5.89%	07/16/2035	1,434	1,412,910	0.3
				<u>5,566,104</u>	<u>1.2</u>
Gesamtanlagen				<u>\$ 471,254,403</u>	<u>97.3%</u>
(Kosten \$501,983,943)					
Termineinlagen					
ANZ, London(c)	2.09 %	–		273,670	0.1
BBH, Grand Cayman(c)	4.10 %	–		131,670	0.0
BBH, Grand Cayman(c)	5.62 %	–		1	0.0
BNP Paribas, Paris(c)	0.24 %	–		4,556	0.0
Citibank, New York(c)	3.93 %	–		4,171,488	0.8
HSBC, Singapore(c)	2.56 %	–		47,737	0.0
Nordea, Oslo(c)	1.60 %	–		47,202	0.0
Scotiabank, Toronto(c)	3.33 %	–		48,190	0.0
SMBC, London(c)	1.53 %	–		243,779	0.1
SMBC, London(c)	2.92 %	–		2,343,546	0.5
SMBC, London(c)	3.93 %	–		18,217	0.0
SMBC, Tokyo(c)	1.53 %	–		33	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>7,330,089</u>	<u>1.5</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>5,572,062</u>	<u>1.2</u>
Nettovermögen				<u>\$ 484,156,554</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
Korea 3 Yr Bond Futures	03/21/2023	287	\$ 22,627,417	\$ 22,359,214	\$ (268,203)
Short					
Australian 3 Yr Bond Futures	03/15/2023	187	13,636,445	13,431,085	205,360
Euro-BOBL Futures	03/08/2023	152	18,973,551	18,517,534	456,017
Euro-Schatz Futures	03/08/2023	294	33,073,205	32,644,979	428,226
					<u>\$ 821,400</u>
				Wertsteigerung	\$ 1,089,603
				Wertminderung	\$ (268,203)

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA	CAD 6,590	USD 4,905	03/01/2023	\$ 75,401
Bank of America, NA	USD 1,937	CNH 13,504	03/01/2023	6,209
Bank of America, NA	CHF 3,753	USD 4,008	03/15/2023	18,017
Bank of America, NA	GBP 12,318	USD 14,808	03/15/2023	(12,343)
Bank of America, NA	JPY 4,197,885	USD 30,873	03/15/2023	(16,040)
Bank of America, NA	USD 2,064	NZD 3,349	03/15/2023	6,371
Bank of America, NA	INR 167,170	USD 2,038	03/16/2023	17,175
Bank of America, NA	USD 5,845	INR 484,915	03/16/2023	18,063
Bank of America, NA	USD 3,955	INR 322,228	03/16/2023	(59,081)

AB FCPI
Short Duration Bond Portfolio

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA	CLP	2,094,249	USD	2,555	03/17/2023	\$ 29,966
Bank of America, NA	USD	1,933	CLP	1,564,556	03/17/2023	(46,559)
Bank of America, NA	KRW	2,207,744	USD	1,746	04/26/2023	71,149
Barclays Bank PLC	CNH	12,999	USD	1,909	03/01/2023	38,208
Barclays Bank PLC	USD	1,910	NOK	19,623	03/01/2023	(20,717)
Barclays Bank PLC	USD	1,924	SGD	2,559	03/01/2023	(26,565)
BNP Paribas SA	EUR	1,918	USD	2,024	03/01/2023	(4,928)
BNP Paribas SA	JPY	4,271,848	USD	32,243	03/01/2023	868,101
BNP Paribas SA	NZD	2,873	USD	1,790	03/01/2023	14,127
BNP Paribas SA	SGD	2,556	USD	1,925	03/01/2023	29,573
BNP Paribas SA	USD	1,974	GBP	1,641	03/01/2023	739
BNP Paribas SA	USD	1,953	NOK	20,133	03/01/2023	(14,094)
BNP Paribas SA	CLP	803,860	USD	968	03/17/2023	(1,259)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	5,047	USD	5,401	03/01/2023	62,866
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD	466	USD	318	03/24/2023	4,057
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD	9	USD	6	03/24/2023	(1)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD	74	USD	55	03/24/2023	397
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	121	USD	129	03/24/2023	622
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	65	USD	78	03/24/2023	228
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD	29	USD	18	03/24/2023	143
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD	11	USD	8	03/24/2023	50
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	8,614	AUD	12,629	03/24/2023	(108,535)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	3,736	CAD	5,062	03/24/2023	(25,280)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	5,489	EUR	5,151	03/24/2023	(34,059)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	4,100	GBP	3,390	03/24/2023	(21,203)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	440	NZD	705	03/24/2023	(3,726)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	530	SGD	709	03/24/2023	(3,667)
Citibank, NA	AUD	49,018	USD	33,985	03/01/2023	1,000,429
Citibank, NA	EUR	42,753	USD	45,440	03/01/2023	220,014
Citibank, NA	JPY	266,851	USD	1,979	03/01/2023	19,523
Citibank, NA	USD	1,953	EUR	1,833	03/01/2023	(13,682)
Citibank, NA	USD	1,949	JPY	260,948	03/01/2023	(32,383)
Citibank, NA	CNH	13,504	USD	1,939	03/02/2023	(4,445)
Citibank, NA	USD	1,940	CNH	13,504	03/15/2023	4,481
Citibank, NA	USD	667	SEK	6,946	03/15/2023	(2,628)
Citibank, NA	INR	485,412	USD	5,892	03/16/2023	23,556
Citibank, NA	INR	482,677	USD	5,809	03/16/2023	(26,374)
Citibank, NA	USD	1,924	INR	159,557	03/16/2023	5,301
Citibank, NA	USD	1,042	CLP	860,338	03/17/2023	(4,803)
Citibank, NA	CAD	8,102	USD	6,073	03/30/2023	133,145
Citibank, NA	KRW	7,372,288	USD	5,987	04/26/2023	392,453
Citibank, NA	USD	1,879	KRW	2,391,707	04/26/2023	(64,410)
Deutsche Bank AG	CAD	11,645	USD	8,581	03/15/2023	46,542
Deutsche Bank AG	EUR	51,601	USD	54,696	03/15/2023	73,774
Deutsche Bank AG	EUR	51,601	USD	54,737	03/22/2023	89,923
HSBC Bank USA	MXN	148,728	USD	7,991	03/01/2023	(138,184)
HSBC Bank USA	NZD	11,954	USD	7,579	03/01/2023	188,403
HSBC Bank USA	SGD	2,640	USD	1,976	03/01/2023	17,905
HSBC Bank USA	USD	3,876	SGD	5,196	03/01/2023	(22,831)
HSBC Bank USA	AUD	48,867	USD	32,863	03/15/2023	(36,114)
HSBC Bank USA	PLN	17,527	USD	3,935	03/15/2023	(1,302)
HSBC Bank USA	USD	3,837	NOK	39,739	03/15/2023	(7,409)
HSBC Bank USA	USD	2,087	INR	170,096	03/16/2023	(30,762)
HSBC Bank USA	CLP	1,030,407	USD	1,288	03/17/2023	45,572
HSBC Bank USA	USD	3,945	CLP	3,157,753	03/17/2023	(136,858)
JPMorgan Chase Bank, NA	CAD	2,675	USD	1,990	03/01/2023	29,627
JPMorgan Chase Bank, NA	EUR	57,860	USD	61,963	03/01/2023	764,671
JPMorgan Chase Bank, NA	PLN	17,524	USD	3,911	03/01/2023	(28,734)
JPMorgan Chase Bank, NA	EUR	1,934	USD	2,043	03/15/2023	(4,157)
JPMorgan Chase Bank, NA	NZD	14,693	USD	9,052	03/15/2023	(32,029)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CAD	2,379	USD	1,781	03/01/2023	37,013
Morgan Stanley & Co. International PLC	CNH	27,872	USD	4,082	03/01/2023	71,104
Morgan Stanley & Co. International PLC	GBP	3,893	USD	4,700	03/01/2023	17,315
Morgan Stanley & Co. International PLC	SEK	19,939	USD	1,913	03/01/2023	8,006
Morgan Stanley & Co. International PLC	USD	5,994	CNH	40,869	03/01/2023	(113,751)
Morgan Stanley & Co. International PLC	USD	1,756	EUR	1,643	03/01/2023	(18,048)
Morgan Stanley & Co. International PLC	KRW	2,390,103	USD	1,840	04/26/2023	25,985
Morgan Stanley & Co. International PLC	USD	3,989	KRW	4,864,158	04/26/2023	(297,660)
Royal Bank of Scotland PLC	JPY	250,503	USD	1,899	03/01/2023	58,848
Standard Chartered Bank	MXN	319,411	USD	17,308	03/15/2023	(105,390)
Standard Chartered Bank	USD	1,897	SGD	2,556	03/15/2023	(880)
Standard Chartered Bank	INR	157,374	USD	1,925	03/16/2023	22,484
Standard Chartered Bank	USD	3,841	INR	317,450	03/16/2023	(2,978)
Standard Chartered Bank	KRW	2,558,794	USD	2,035	04/26/2023	93,603

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Standard Chartered Bank	USD 1,987	KRW 2,510,831	04/26/2023	\$ (81,827)
UBS AG	CHF 3,757	USD 4,073	03/01/2023	83,827
UBS AG	GBP 10,067	USD 12,166	03/01/2023	57,783
UBS AG	MXN 170,683	USD 9,119	03/01/2023	(209,698)
UBS AG	USD 2,453	JPY 330,368	03/01/2023	(26,330)
UBS AG	USD 2,577	SEK 26,885	03/01/2023	(8,505)
UBS AG	EUR 39,593	USD 42,354	03/08/2023	461,243
UBS AG	CLP 1,728,126	USD 2,078	03/17/2023	(6,209)
UBS AG	USD 4,054	CLP 3,195,138	03/17/2023	(200,581)
				<u>\$ 3,196,973</u>
			Wertsteigerung	\$ 5,253,992
			Wertminderung	\$ (2,057,019)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	NZD 5,263	11/01/2024	3 Month BKBM	2.580%	\$ (147,788)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	NZD 12,950	11/10/2024	3 Month BKBM	2.448%	(385,910)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	NZD 14,077	11/02/2024	3 Month BKBM	2.503%	(407,105)
Insgesamt					<u>\$ (940,803)</u>

* Kapitalbetrag geringer als 500.

- (a) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für offene OTC-Derivate zu dienen.
 (b) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 28. Februar 2023.
 (c) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD	– Australian Dollar
CAD	– Canadian Dollar
CHF	– Swiss Franc
CLP	– Chilean Peso
CNH	– Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
EUR	– Euro
GBP	– Great British Pound
INR	– Indian Rupee
JPY	– Japanese Yen
KRW	– South Korean Won
MXN	– Mexican Peso
NOK	– Norwegian Krone
NZD	– New Zealand Dollar
PEN	– Peruvian Sol
PLN	– Polish Zloty
SEK	– Swedish Krona
SGD	– Singapore Dollar
USD	– United States Dollar

Glossar:

- BKBM – Bank Bill Benchmark (New Zealand)
- BOBL – Bundesobligationen
- CLO – Collateralized Loan Obligations
- CMBS – Commercial Mortgage-Backed Securities
- LCH – London Clearing House
- OAT – Obligations Assimilables du Trésor
- REIT – Real Estate Investment Trust

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Advanced Drainage Systems, Inc.	5.00%	09/30/2027	USD 2,804	\$ 2,610,260	0.0%
ASP Unifrax Holdings, Inc.	5.25%	09/30/2028	13,175	10,223,872	0.1
ASP Unifrax Holdings, Inc.	7.50%	09/30/2029	14,148	9,652,018	0.1
Big River Steel LLC/BRS Finance Corp.	6.63%	01/31/2029	20,800	20,304,441	0.2
Cleveland-Cliffs, Inc.	6.75%	03/15/2026	2,020	2,041,217	0.0
Constellium SE	3.13%	07/15/2029	EUR 10,042	8,456,020	0.1
Constellium SE	3.75%	04/15/2029	USD 1,000	824,816	0.0
CVR Partners LP/CVR Nitrogen Finance Corp.	6.13%	06/15/2028	14,545	13,051,138	0.1
Diamond BC BV	4.63%	10/01/2029	1,728	1,419,691	0.0
Element Solutions, Inc.	3.88%	09/01/2028	4,747	4,112,447	0.0
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	4.38%	04/01/2031	13,186	11,087,216	0.1
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	4.50%	09/15/2027	3,648	3,362,717	0.0
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	6.13%	04/15/2032	42,477	40,071,423	0.3
Guala Closures SpA	3.25%	06/15/2028	EUR 268	240,413	0.0
Hecla Mining Co.	7.25%	02/15/2028	USD 25,670	25,119,077	0.2
Ingevity Corp.	3.88%	11/01/2028	3,728	3,196,865	0.0
Intelligent Packaging Holdco Issuer LP(a)	9.00%	01/15/2026	12,133	8,728,500	0.1
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc./ Intelligent Packaging Ltd. Co-Issuer LLC	6.00%	09/15/2028	29,516	25,650,804	0.2
Olympus Water US Holding Corp.	7.13%	10/01/2027	9,353	8,981,850	0.1
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	4.38%	11/01/2026	EUR 5,856	5,699,547	0.0
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	5.38%	11/01/2026	USD 21,559	19,372,680	0.1
Sealed Air Corp.	6.13%	02/01/2028	5,295	5,214,184	0.0
Valvoline, Inc.	3.63%	06/15/2031	1,000	808,648	0.0
Vibrantz Technologies, Inc.	9.00%	02/15/2030	46,334	36,196,186	0.3
WR Grace Holdings LLC	4.88%	06/15/2027	21,036	19,337,063	0.1
WR Grace Holdings LLC	5.63%	08/15/2029	5,844	4,709,635	0.0
				<u>290,472,728</u>	<u>2.1</u>
INVESTITIONSGÜTER					
ARD Finance SA(a)	5.00%	06/30/2027	EUR 50,431	40,884,948	0.3
ARD Finance SA(a)	6.50%	06/30/2027	USD 14,019	11,464,244	0.1
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/ Ardagh Metal Packaging Finance PLC	2.00%	09/01/2028	EUR 700	601,016	0.0
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/ Ardagh Metal Packaging Finance PLC	4.00%	09/01/2029	USD 1,000	798,750	0.0
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/ Ardagh Metal Packaging Finance PLC	6.00%	06/15/2027	2,931	2,828,415	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	2.13%	08/15/2026	EUR 700	637,917	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	4.13%	08/15/2026	USD 6,000	5,481,813	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	5.25%	08/15/2027	3,000	2,469,973	0.0
Ball Corp.	2.88%	08/15/2030	2,000	1,599,726	0.0
Bombardier, Inc.	7.88%	04/15/2027	541	537,476	0.0
Chart Industries, Inc.	7.50%	01/01/2030	8,185	8,310,326	0.1
Clean Harbors, Inc.	5.13%	07/15/2029	2,611	2,441,785	0.0
Clean Harbors, Inc.	6.38%	02/01/2031	2,813	2,803,604	0.0
Crown Americas LLC	5.25%	04/01/2030	6,071	5,666,999	0.0
Eco Material Technologies, Inc.	7.88%	01/31/2027	32,988	31,626,844	0.2
EnerSys	4.38%	12/15/2027	18,085	16,548,832	0.1
F-Brasile SpA/F-Brasile US LLC, Series XR	7.38%	08/15/2026	20,200	16,420,276	0.1
Gates Global LLC/Gates Corp.	6.25%	01/15/2026	23,892	23,344,634	0.2
GFL Environmental, Inc.	3.50%	09/01/2028	1,000	873,374	0.0
GFL Environmental, Inc.	4.75%	06/15/2029	16,492	14,671,087	0.1
Granite US Holdings Corp.	11.00%	10/01/2027	27,965	29,461,940	0.2
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028	30,684	28,249,835	0.2
Harsco Corp.	5.75%	07/31/2027	16,968	14,467,115	0.1
IMA Industria Macchine Automatiche SpA	3.75%	01/15/2028	EUR 700	644,434	0.0
JELD-WEN, Inc.	4.63%	12/15/2025	USD 2,036	1,829,858	0.0
LSB Industries, Inc.	6.25%	10/15/2028	9,141	8,320,309	0.1
Madison IAQ LLC	5.88%	06/30/2029	35,189	28,063,228	0.2
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027	7,075	6,502,791	0.1
Renk AG/Frankfurt am Main	5.75%	07/15/2025	EUR 15,007	15,594,835	0.1
Titan Holdings II BV	5.13%	07/15/2029	12,355	10,308,346	0.1
TK Elevator Holdco GmbH	7.63%	07/15/2028	USD 7,893	7,187,451	0.1
TK Elevator Midco GmbH	4.38%	07/15/2027	EUR 1,200	1,147,974	0.0
TK Elevator US Newco, Inc.	5.25%	07/15/2027	USD 16,684	15,209,956	0.1
Triumph Group, Inc.	6.25%	09/15/2024	8,957	8,967,545	0.1
Triumph Group, Inc.	7.75%	08/15/2025	8,167	7,845,528	0.1
Triumph Group, Inc.	8.88%	06/01/2024	13,103	13,692,368	0.1
Trivium Packaging Finance BV	3.75%	08/15/2026	EUR 2,266	2,193,025	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
WESCO Distribution, Inc.	7.13%	06/15/2025	USD 31,560	\$ 31,886,591	0.2%
WESCO Distribution, Inc.	7.25%	06/15/2028	10,669	10,840,396	0.1
				432,425,564	3.1
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Adevinta ASA	3.00%	11/15/2027	EUR 700	672,258	0.0
Advantage Sales & Marketing, Inc.	6.50%	11/15/2028	USD 30,458	23,275,931	0.2
Altice Financing SA.	3.00%	01/15/2028	EUR 700	589,228	0.0
Altice Financing SA.	5.75%	08/15/2029	USD 73,220	60,336,598	0.4
AMC Networks, Inc.	4.25%	02/15/2029	7,963	5,862,116	0.1
AMC Networks, Inc.	4.75%	08/01/2025	35,536	33,611,923	0.2
Arches Buyer, Inc.	4.25%	06/01/2028	1,728	1,421,432	0.0
Arches Buyer, Inc.	6.13%	12/01/2028	8,568	7,050,838	0.1
Banjay Entertainment SASU	5.38%	03/01/2025	6,576	6,385,759	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.25%	01/15/2034	22,642	16,950,925	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	08/15/2030	21,000	17,316,771	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.75%	02/01/2032	22,214	18,092,787	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.00%	02/01/2028	1,000	906,914	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	6.38%	09/01/2029	10,989	10,250,425	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	7.38%	03/01/2031	4,292	4,164,365	0.0
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027	35,824	31,976,212	0.2
CSC Holdings LLC	3.38%	02/15/2031	1,728	1,185,225	0.0
CSC Holdings LLC	4.50%	11/15/2031	5,000	3,564,514	0.0
CSC Holdings LLC	4.63%	12/01/2030	12,626	6,797,259	0.1
CSC Holdings LLC	5.38%	02/01/2028	7,197	6,004,270	0.1
CSC Holdings LLC	5.75%	01/15/2030	32,214	18,441,737	0.1
CSC Holdings LLC	6.50%	02/01/2029	1,000	847,814	0.0
CSC Holdings LLC	7.50%	04/01/2028	17,996	12,038,415	0.1
DISH DBS Corp.	5.25%	12/01/2026	34,691	28,982,045	0.2
DISH DBS Corp.	5.75%	12/01/2028	30,009	23,968,322	0.2
DISH DBS Corp.	5.88%	11/15/2024	4,019	3,757,330	0.0
DISH Network Corp.(b).	3.38%	08/15/2026	6,494	4,095,175	0.0
Gray Escrow II, Inc.	5.38%	11/15/2031	31,385	23,303,272	0.2
Gray Television, Inc.	5.88%	07/15/2026	3,728	3,380,106	0.0
Gray Television, Inc.	7.00%	05/15/2027	2,500	2,262,722	0.0
iHeartCommunications, Inc.	4.75%	01/15/2028	9,137	7,709,064	0.1
iHeartCommunications, Inc.	5.25%	08/15/2027	15,176	13,240,686	0.1
iHeartCommunications, Inc.	6.38%	05/01/2026	2,630	2,477,963	0.0
iHeartCommunications, Inc.	8.38%	05/01/2027	4,768	4,191,364	0.0
LCPR Senior Secured Financing DAC	5.13%	07/15/2029	27,724	23,373,188	0.2
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027	22,229	20,610,268	0.2
McGraw-Hill Education, Inc.	5.75%	08/01/2028	38,388	33,620,498	0.3
National CineMedia LLC	5.88%	04/15/2028	12,566	3,950,244	0.0
Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp.	4.63%	03/15/2030	8,826	7,237,322	0.1
Scripps Escrow II, Inc.	3.88%	01/15/2029	1,895	1,509,785	0.0
Sinclair Television Group, Inc.	4.13%	12/01/2030	5,620	4,355,297	0.0
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030	23,135	17,020,285	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	4.00%	07/15/2028	62,167	53,204,100	0.4
Sirius XM Radio, Inc.	5.00%	08/01/2027	6,335	5,813,688	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	5.50%	07/01/2029	4,891	4,408,885	0.0
Summer BC Bidco B LLC	5.50%	10/31/2026	6,800	5,845,390	0.1
Summer BC Holdco B SARL	5.75%	10/31/2026	EUR 19,048	17,888,813	0.1
Summer BidCo BV(a)	9.00%	11/15/2025	8,540	7,056,572	0.1
TEGNA, Inc.	4.75%	03/15/2026	USD 4,806	4,566,062	0.0
TEGNA, Inc.	5.00%	09/15/2029	16,735	14,879,091	0.1
Univision Communications, Inc.	4.50%	05/01/2029	5,371	4,530,390	0.0
Univision Communications, Inc.	6.63%	06/01/2027	29,088	27,722,702	0.2
Univision Communications, Inc.	7.38%	06/30/2030	18,576	17,625,220	0.1
UPCB Finance VII Ltd.	3.63%	06/15/2029	EUR 700	652,337	0.0
Urban One, Inc.	7.38%	02/01/2028	USD 49,053	43,691,085	0.3
Virgin Media Finance PLC	3.75%	07/15/2030	EUR 700	572,418	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC	4.50%	08/15/2030	USD 6,000	4,968,824	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC	5.00%	04/15/2027	GBP 2,000	2,237,908	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC	5.50%	05/15/2029	USD 1,952	1,763,560	0.0
Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC	5.00%	07/15/2028	2,300	2,003,475	0.0
VZ Secured Financing BV	3.50%	01/15/2032	EUR 6,945	5,728,722	0.1
Ziggo Bond Co. BV	5.13%	02/28/2030	USD 4,484	3,584,636	0.0
Ziggo Bond Co. BV	6.00%	01/15/2027	820	765,090	0.0
Ziggo BV	2.88%	01/15/2030	EUR 2,374	2,013,025	0.0
				748,310,645	5.4
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Altice France SA/France	5.13%	07/15/2029	USD 8,692	6,703,489	0.0
Altice France SA/France	5.88%	02/01/2027	EUR 1,200	1,125,818	0.0
Altice France SA/France	8.13%	02/01/2027	USD 8,421	7,868,758	0.1
Connect Finco SARL/Connect US Finco LLC	6.75%	10/01/2026	40,626	37,680,615	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Consolidated Communications, Inc.	5.00%	10/01/2028	USD 16,110	\$ 10,746,772	0.1%
Consolidated Communications, Inc.	6.50%	10/01/2028	35,835	25,828,330	0.2
Embarq Corp.	8.00%	06/01/2036	32,601	14,169,684	0.1
Hughes Satellite Systems Corp.	6.63%	08/01/2026	13,000	12,434,311	0.1
Iliad Holading SASU	5.13%	10/15/2026	EUR 2,998	2,991,931	0.0
Iliad Holding SASU	6.50%	10/15/2026	USD 9,478	8,899,192	0.1
Iliad Holding SASU	7.00%	10/15/2028	8,644	7,982,034	0.1
Kaixo Bondco Telecom SA	5.13%	09/30/2029	EUR 14,269	13,026,481	0.1
Level 3 Financing, Inc.	3.75%	07/15/2029	USD 13,050	8,207,771	0.1
Level 3 Financing, Inc.	4.25%	07/01/2028	9,052	6,173,944	0.0
Level 3 Financing, Inc.	4.63%	09/15/2027	17,665	13,198,063	0.1
Lorca Telecom Bondco SA	4.00%	09/18/2027	EUR 9,462	9,022,382	0.1
Nexstar Media, Inc.	5.63%	07/15/2027	USD 12,783	11,871,726	0.1
Telecom Italia Capital SA	6.00%	09/30/2034	2,000	1,673,071	0.0
Telecom Italia Capital SA	7.20%	07/18/2036	31,658	27,915,379	0.2
Telecom Italia Capital SA	7.72%	06/04/2038	13,001	11,819,519	0.1
Telecom Italia SpA/Milano	5.30%	05/30/2024	1,000	970,870	0.0
United Group BV	3.63%	02/15/2028	EUR 5,387	4,347,389	0.0
United Group BV	4.00%	11/15/2027	14,021	11,717,803	0.1
United Group BV	4.63%	08/15/2028	3,991	3,350,919	0.0
Vmed O2 UK Financing I PLC	4.75%	07/15/2031	USD 42,248	34,907,719	0.2
Vodafone Group PLC	4.13%	06/04/2081	17,526	13,906,030	0.1
				<u>308,540,002</u>	<u>2.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Adient Global Holdings Ltd.	4.88%	08/15/2026	1,000	932,411	0.0
Allison Transmission, Inc.	3.75%	01/30/2031	1,000	829,690	0.0
Allison Transmission, Inc.	5.88%	06/01/2029	7,094	6,721,955	0.1
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.25%	03/15/2026	1,790	1,695,059	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.50%	04/01/2027	1,890	1,743,640	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.88%	07/01/2028	15,455	13,867,637	0.1
Aston Martin Capital Holdings Ltd.	10.50%	11/30/2025	33,451	33,221,178	0.2
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	4.38%	05/15/2026	EUR 3,111	3,096,158	0.0
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	6.25%	05/15/2026	USD 3,621	3,554,080	0.0
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	8.50%	05/15/2027	39,562	39,327,987	0.3
Dana, Inc.	5.38%	11/15/2027	232	214,117	0.0
Dana, Inc.	5.63%	06/15/2028	3,358	3,040,912	0.0
Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC	8.00%	02/01/2028	36,163	32,843,602	0.2
Ford Motor Co.	6.10%	08/19/2032	59,885	55,969,734	0.4
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	5.00%	07/15/2029	18,432	16,038,682	0.1
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	5.25%	07/15/2031	7,593	6,456,777	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(a)	3.75%	09/15/2026	EUR 1,111	1,065,686	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(a)	4.75%	09/15/2026	USD 12,039	11,112,257	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(a)	6.00%	05/15/2027	15,335	14,248,083	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(a)	6.38%	05/15/2029	15,335	13,844,564	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.50%	07/15/2029	10,597	8,504,585	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	01/15/2028	28,297	24,251,722	0.2
Jaguar Land Rover Automotive PLC	7.75%	10/15/2025	24,649	24,325,936	0.2
Mclaren Finance PLC	7.50%	08/01/2026	31,275	24,320,565	0.2
Titan International, Inc.	7.00%	04/30/2028	24,723	23,426,672	0.2
ZF Finance GmbH	2.00%	05/06/2027	EUR 700	637,255	0.0
ZF Finance GmbH	3.75%	09/21/2028	4,300	4,037,226	0.0
ZF North America Capital, Inc.	4.75%	04/29/2025	USD 33,093	31,592,652	0.2
				<u>400,920,822</u>	<u>2.9</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	4.00%	08/01/2028	15,210	12,859,142	0.1
Carnival Corp.	5.75%	03/01/2027	29,310	24,034,200	0.2
Carnival Corp.	7.63%	03/01/2026	EUR 6,154	5,788,058	0.0
Carnival Corp.	9.88%	08/01/2027	USD 13,439	13,606,988	0.1
Carnival Corp.	10.13%	02/01/2026	EUR 6,153	6,783,182	0.1
Carnival Corp.	10.50%	02/01/2026	USD 1,000	1,032,500	0.0
Cedar Fair LP	5.25%	07/15/2029	2,000	1,830,263	0.0
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op.	5.38%	04/15/2027	8,835	8,438,265	0.1
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op.	5.50%	05/01/2025	39,998	39,552,018	0.3
Lindblad Expeditions LLC	6.75%	02/15/2027	9,468	8,995,652	0.1
Motion Bondco DAC	4.50%	11/15/2027	EUR 13,300	12,529,888	0.1
NCL Corp., Ltd.	5.88%	03/15/2026	USD 29,640	25,752,357	0.2
NCL Corp., Ltd.	8.38%	02/01/2028	5,743	5,836,664	0.0
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.38%	07/15/2027	16,520	14,496,300	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	08/31/2026	18,015	16,515,431	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	04/01/2028	13,254	11,522,696	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	7.25%	01/15/2030	5,857	5,871,643	0.0
Royal Caribbean Cruises Ltd.	9.25%	01/15/2029	16,842	17,873,573	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	5.25%	08/15/2029	USD 8,323	\$ 7,428,169	0.1%
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	8.75%	05/01/2025	19,206	19,639,957	0.1
Six Flags Entertainment Corp.	5.50%	04/15/2027	2,000	1,886,023	0.0
Vail Resorts, Inc.	6.25%	05/15/2025	7,759	7,759,000	0.1
Viking Cruises Ltd.	5.88%	09/15/2027	39,000	33,451,140	0.2
Viking Cruises Ltd.	7.00%	02/15/2029	14,231	12,241,654	0.1
Viking Cruises Ltd.	13.00%	05/15/2025	12,492	13,268,108	0.1
VOC Escrow Ltd.	5.00%	02/15/2028	3,728	3,283,091	0.0
				332,275,962	2.4
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Adams Homes, Inc.	7.50%	02/15/2025	13,146	11,529,781	0.1
Beazer Homes USA, Inc.	6.75%	03/15/2025	21,605	21,459,753	0.2
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	4.88%	02/15/2030	26,127	19,671,096	0.1
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	6.25%	09/15/2027	19,888	17,463,848	0.1
Builders FirstSource, Inc.	6.38%	06/15/2032	20,332	19,545,260	0.1
Caesars Entertainment, Inc.	6.25%	07/01/2025	22,343	22,172,806	0.2
Caesars Entertainment, Inc.	7.00%	02/15/2030	6,928	6,977,195	0.1
Castle UK Finco PLC	7.00%	05/15/2029	GBP 17,251	16,320,457	0.1
Castle UK Finco PLC(c)	7.90%	05/15/2028	EUR 10,088	9,105,902	0.1
Churchill Downs, Inc.	5.50%	04/01/2027	USD 2,000	1,900,621	0.0
Everi Holdings, Inc.	5.00%	07/15/2029	3,865	3,403,351	0.0
Five Point Operating Co. LP/Five Point Capital Corp.	7.88%	11/15/2025	31,206	28,245,955	0.2
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	3.63%	02/15/2032	1,000	820,661	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.38%	05/01/2025	3,320	3,282,789	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.75%	05/01/2028	5,733	5,579,172	0.0
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower Esc	4.88%	07/01/2031	18,956	15,937,073	0.1
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower Esc	5.00%	06/01/2029	32,204	28,331,549	0.2
Installed Building Products, Inc.	5.75%	02/01/2028	5,705	5,300,375	0.0
KB Home	4.80%	11/15/2029	5,544	4,868,621	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc.	4.50%	06/15/2029	9,893	8,294,782	0.1
Mattamy Group Corp.	4.63%	03/01/2030	30,100	24,938,613	0.2
MGM Resorts International	4.75%	10/15/2028	12,920	11,578,915	0.1
NH Hotel Group SA.	4.00%	07/02/2026	EUR 3,824	3,832,363	0.0
Scientific Games International, Inc.	7.00%	05/15/2028	USD 7,525	7,357,358	0.1
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	02/15/2028	10,577	9,404,088	0.1
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	04/01/2029	14,461	12,715,449	0.1
Standard Industries, Inc./NJ	5.00%	02/15/2027	1,000	924,923	0.0
Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP/ Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp.	5.88%	05/15/2025	22,618	21,530,466	0.2
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.75%	01/15/2028	14,127	13,334,202	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.88%	06/15/2027	9,351	8,956,774	0.1
Travel + Leisure Co.	4.50%	12/01/2029	18,438	15,530,227	0.1
Travel + Leisure Co.	4.63%	03/01/2030	15,276	12,849,080	0.1
Travel + Leisure Co.	6.00%	04/01/2027	4,000	3,868,165	0.0
Travel + Leisure Co.	6.63%	07/31/2026	29,164	28,654,234	0.2
Victors Merger Corp.	6.38%	05/15/2029	38,070	23,964,818	0.2
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.25%	05/15/2027	18,930	17,649,286	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	5.13%	10/01/2029	19,690	17,600,890	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	7.13%	02/15/2031	4,769	4,751,280	0.0
				489,652,178	3.5
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	3.88%	01/15/2028	1,000	892,150	0.0
IRB Holding Corp.	7.00%	06/15/2025	10,678	10,678,000	0.1
Papa John's International, Inc.	3.88%	09/15/2029	5,437	4,543,924	0.0
				16,114,074	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Arko Corp.	5.13%	11/15/2029	18,547	14,677,393	0.1
Asbury Automotive Group, Inc.	4.63%	11/15/2029	16,345	14,192,837	0.1
Asbury Automotive Group, Inc.	5.00%	02/15/2032	7,235	6,198,330	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.63%	10/01/2030	11,815	11,198,756	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.75%	07/01/2036	15,130	13,076,651	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.88%	11/01/2035	15,281	13,460,250	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.95%	03/01/2033	13,864	12,083,893	0.1
Bath & Body Works, Inc.	7.50%	06/15/2029	5,283	5,298,741	0.0
Bath & Body Works, Inc.	7.60%	07/15/2037	4,421	3,747,937	0.0
Bath & Body Works, Inc.	9.38%	07/01/2025	1,656	1,752,528	0.0
BCPE Ulysses Intermediate, Inc.(a)	7.75%	04/01/2027	19,207	13,845,428	0.1
Carvana Co.	5.50%	04/15/2027	2,126	1,081,819	0.0
Carvana Co.	5.88%	10/01/2028	6,595	3,246,045	0.0
FirstCash, Inc.	4.63%	09/01/2028	1,000	869,293	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
FirstCash, Inc.	5.63%	01/01/2030	USD 19,645	\$ 17,443,084	0.1%
Foundation Building Materials, Inc.	6.00%	03/01/2029	5,396	4,285,871	0.0
Group 1 Automotive, Inc.	4.00%	08/15/2028	1,740	1,493,243	0.0
Hanesbrands, Inc.	4.88%	05/15/2026	2,000	1,846,300	0.0
Kontoor Brands, Inc.	4.13%	11/15/2029	23,553	19,887,322	0.2
Levi Strauss & Co.	3.50%	03/01/2031	3,818	3,126,455	0.0
Michaels Cos, Inc. (The)	7.88%	05/01/2029	23,755	17,992,823	0.1
Murphy Oil USA, Inc.	5.63%	05/01/2027	1,441	1,377,399	0.0
NMG Holding Co., Inc./Neiman Marcus Group LLC	7.13%	04/01/2026	38,026	36,650,060	0.3
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.	4.75%	02/15/2028	4,641	4,248,074	0.0
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.	7.75%	02/15/2029	40,041	39,033,999	0.3
Rite Aid Corp.	7.50%	07/01/2025	16,583	11,731,014	0.1
Rite Aid Corp.	8.00%	11/15/2026	21,400	11,374,049	0.1
Sonic Automotive, Inc.	4.63%	11/15/2029	5,654	4,665,869	0.0
Sonic Automotive, Inc.	4.88%	11/15/2031	8,258	6,575,110	0.1
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp.	6.38%	09/30/2026	23,041	21,145,492	0.2
SRS Distribution, Inc.	6.13%	07/01/2029	4,009	3,374,045	0.0
Staples, Inc.	7.50%	04/15/2026	17,003	15,126,311	0.1
Staples, Inc.	10.75%	04/15/2027	43,095	32,901,160	0.2
TPro Acquisition Corp.	11.00%	10/15/2024	16,176	15,834,423	0.1
White Cap Buyer LLC	6.88%	10/15/2028	20,285	18,408,367	0.1
White Cap Parent LLC(a)	8.25%	03/15/2026	7,186	6,781,966	0.1
Wolverine World Wide, Inc.	4.00%	08/15/2029	1,000	806,106	0.0
				<u>410,838,443</u>	<u>2.9</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
AdaptHealth LLC	4.63%	08/01/2029	1,000	839,630	0.0
AdaptHealth LLC	5.13%	03/01/2030	24,648	21,256,799	0.2
AdaptHealth LLC	6.13%	08/01/2028	5,430	5,009,688	0.0
AHP Health Partners, Inc.	5.75%	07/15/2029	20,045	16,783,862	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	3.50%	03/15/2029	2,000	1,696,851	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	4.63%	01/15/2027	12,062	11,336,072	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	4.88%	02/15/2030	7,984	7,189,215	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	5.88%	02/15/2028	1,000	967,169	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	6.50%	02/15/2028	6,180	6,144,512	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	7.50%	03/15/2026	5,667	5,780,611	0.0
Avantor Funding, Inc.	3.88%	07/15/2028	EUR 700	679,254	0.0
Bausch Health Americas, Inc.	8.50%	01/31/2027	USD 15,514	8,151,974	0.1
Bausch Health Cos., Inc.	5.75%	08/15/2027	3,475	2,310,865	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	6.25%	02/15/2029	9,519	4,110,862	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	7.25%	05/30/2029	9,800	4,342,263	0.0
Cab Selas	3.38%	02/01/2028	EUR 4,291	3,668,291	0.0
CD&R Smokey Buyer, Inc.	6.75%	07/15/2025	USD 13,158	11,476,141	0.1
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	3.50%	02/11/2027	EUR 700	655,704	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.	5.63%	03/15/2027	USD 7,408	6,513,950	0.1
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.00%	01/15/2029	7,082	6,158,131	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.13%	04/01/2030	17,452	11,933,935	0.1
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.88%	04/01/2028	2,000	1,356,437	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.88%	04/15/2029	33,534	23,548,861	0.2
Darling Ingredients, Inc.	6.00%	06/15/2030	11,280	10,904,704	0.1
DaVita, Inc.	3.75%	02/15/2031	1,000	757,279	0.0
DaVita, Inc.	4.63%	06/01/2030	38,000	31,306,448	0.2
Elanco Animal Health, Inc.	6.65%	08/28/2028	12,173	11,623,514	0.1
Embecka Corp.	5.00%	02/15/2030	24,045	20,389,354	0.2
Garden Spinco Corp.	8.63%	07/20/2030	13,172	13,919,165	0.1
Global Medical Response, Inc.	6.50%	10/01/2025	16,815	12,644,732	0.1
Grifols Escrow Issuer SA	3.88%	10/15/2028	EUR 12,604	11,319,645	0.1
Grifols Escrow Issuer SA	4.75%	10/15/2028	USD 10,153	8,682,617	0.1
Gruenthal GmbH	4.13%	05/15/2028	EUR 6,564	6,096,075	0.0
IQVIA, Inc.	2.25%	03/15/2029	700	614,524	0.0
Jazz Securities DAC	4.38%	01/15/2029	USD 1,000	885,435	0.0
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc.	7.00%	12/31/2027	49,853	42,986,929	0.3
Lamb Weston Holdings, Inc.	4.13%	01/31/2030	3,000	2,643,122	0.0
Legacy LifePoint Health LLC	4.38%	02/15/2027	1,000	843,310	0.0
Legacy LifePoint Health LLC	6.75%	04/15/2025	1,667	1,589,412	0.0
LifePoint Health, Inc.	5.38%	01/15/2029	3,000	1,969,843	0.0
Mallinckrodt International Finance SA/Mallinckrodt CB LLC.	10.00%	06/15/2029	2,285	1,404,808	0.0
Medline Borrower LP	3.88%	04/01/2029	25,280	21,080,555	0.2
Medline Borrower LP	5.25%	10/01/2029	40,404	33,176,793	0.2
ModivCare Escrow Issuer, Inc.	5.00%	10/01/2029	1,999	1,707,034	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Option Care Health, Inc.	4.38%	10/31/2029	USD 21,312	\$ 18,261,389	0.1%
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV	4.13%	04/30/2028	18,427	16,258,201	0.1
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV	2.88%	04/30/2028	EUR 1,200	1,092,208	0.0
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV	5.13%	04/30/2031	USD 11,076	9,440,166	0.1
Perrigo Finance Unlimited Co.	4.40%	06/15/2030	245	209,081	0.0
Post Holdings, Inc.	5.50%	12/15/2029	26,783	24,568,760	0.2
Post Holdings, Inc.	5.63%	01/15/2028	3,097	2,971,750	0.0
Primo Water Holdings, Inc.	4.38%	04/30/2029	2,589	2,221,018	0.0
Radiology Partners, Inc.	9.25%	02/01/2028	36,585	22,414,200	0.2
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc./ LifePoint Health, Inc.	9.75%	12/01/2026	47,895	40,817,096	0.3
RP Escrow Issuer LLC	5.25%	12/15/2025	12,237	9,558,570	0.1
Spectrum Brands, Inc.	3.88%	03/15/2031	25,239	19,968,149	0.1
Tenet Healthcare Corp.	6.13%	10/01/2028	3,049	2,821,996	0.0
Tenet Healthcare Corp.	6.13%	06/15/2030	11,559	11,019,245	0.1
Tenet Healthcare Corp.	6.25%	02/01/2027	5,000	4,869,337	0.0
Triton Water Holdings, Inc.	6.25%	04/01/2029	16,820	13,360,492	0.1
US Acute Care Solutions LLC	6.38%	03/01/2026	15,117	13,399,237	0.1
US Foods, Inc.	4.63%	06/01/2030	10,566	9,261,422	0.1
US Renal Care, Inc.	10.63%	07/15/2027	27,853	8,834,452	0.1
				629,803,144	4.5
ENERGIE					
Berry Petroleum Co. LLC	7.00%	02/15/2026	9,146	8,623,139	0.1
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	7.63%	12/15/2025	13,168	13,246,038	0.1
Callon Petroleum Co.	8.00%	08/01/2028	18,463	18,111,866	0.1
Callon Petroleum Co.	8.25%	07/15/2025	6,693	6,698,046	0.1
Citgo Holding, Inc.	9.25%	08/01/2024	31,077	31,183,975	0.2
CITGO Petroleum Corp.	6.38%	06/15/2026	11,351	11,041,273	0.1
CITGO Petroleum Corp.	7.00%	06/15/2025	37,747	37,148,969	0.3
Civitas Resources, Inc.	5.00%	10/15/2026	2,989	2,767,823	0.0
CNX Resources Corp.	6.00%	01/15/2029	11,727	10,630,096	0.1
CNX Resources Corp.	7.25%	03/14/2027	305	302,556	0.0
Comstock Resources, Inc.	5.88%	01/15/2030	3,578	3,077,093	0.0
Comstock Resources, Inc.	6.75%	03/01/2029	14,500	13,342,566	0.1
CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC	5.50%	06/15/2031	24,829	21,769,742	0.2
Crescent Energy Finance LLC	7.25%	05/01/2026	12,658	11,798,272	0.1
Encino Acquisition Partners Holdings LLC	8.50%	05/01/2028	25,563	22,488,369	0.2
EQM Midstream Partners LP	4.50%	01/15/2029	1,108	926,547	0.0
EQM Midstream Partners LP	4.75%	01/15/2031	2,520	2,047,758	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.25%	05/15/2026	2,873	2,721,341	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.50%	10/01/2025	9,056	8,735,095	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	7.75%	02/01/2028	15,114	14,502,796	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	8.00%	01/15/2027	6,733	6,580,662	0.0
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	6.88%	01/15/2029	8,328	7,772,573	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	7.00%	08/01/2027	8,217	7,851,903	0.1
Gulfport Energy Corp.	8.00%	05/17/2026	11,726	11,395,512	0.1
Harbour Energy PLC	5.50%	10/15/2026	10,197	9,365,062	0.1
Hess Midstream Operations LP	4.25%	02/15/2030	2,753	2,323,217	0.0
Hess Midstream Operations LP	5.63%	02/15/2026	10,815	10,513,921	0.1
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	5.75%	02/01/2029	4,680	4,246,917	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	6.00%	02/01/2031	9,196	8,281,896	0.1
Ithaca Energy North Sea PLC	9.00%	07/15/2026	6,175	6,082,447	0.0
ITT Holdings LLC	6.50%	08/01/2029	36,941	30,376,616	0.2
Moss Creek Resources Holdings, Inc.	7.50%	01/15/2026	44,211	39,792,311	0.3
Nabors Industries Ltd.	7.25%	01/15/2026	15,170	14,431,500	0.1
Nabors Industries Ltd.	7.50%	01/15/2028	20,724	19,324,193	0.1
Nabors Industries, Inc.	7.38%	05/15/2027	20,521	19,741,715	0.1
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	02/01/2026	29,689	28,345,738	0.2
NuStar Logistics LP	6.38%	10/01/2030	3,771	3,529,807	0.0
Occidental Petroleum Corp.	5.50%	12/01/2025	5,236	5,181,655	0.0
Occidental Petroleum Corp.	5.88%	09/01/2025	4,883	4,882,963	0.0
Occidental Petroleum Corp.	6.13%	01/01/2031	3,743	3,769,221	0.0
Occidental Petroleum Corp.	8.50%	07/15/2027	3,851	4,131,251	0.0
Occidental Petroleum Corp.	8.88%	07/15/2030	8,851	10,060,010	0.1
PDC Energy, Inc.	5.75%	05/15/2026	12,397	11,883,587	0.1
SM Energy Co.	6.63%	01/15/2027	2,000	1,909,398	0.0
SM Energy Co.	6.75%	09/15/2026	8,555	8,252,936	0.1
Southwestern Energy Co.	5.38%	02/01/2029	18,012	16,854,485	0.1
Southwestern Energy Co.	8.38%	09/15/2028	4,053	4,238,450	0.0
Summit Midstream Holdings LLC/ Summit Midstream Finance Corp.	8.50%	10/15/2026	18,457	17,548,502	0.1
Sunnova Energy Corp.	5.88%	09/01/2026	12,285	10,701,548	0.1
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	5.88%	03/15/2028	26,261	25,297,672	0.2
Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp.	6.00%	12/31/2030	2,644	2,280,408	0.0
Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp.	6.00%	09/01/2031	1,151	983,943	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Transocean Poseidon Ltd.	6.88%	02/01/2027	USD 813	\$ 792,483	0.0%
Venture Global Calcasieu Pass LLC	4.13%	08/15/2031	4,979	4,271,381	0.0
Weatherford International Ltd.....	11.00%	12/01/2024	41	42,034	0.0
				<u>604,201,277</u>	<u>4.3</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
American Builders & Contractors Supply Co., Inc.	4.00%	01/15/2028	652	583,540	0.0
Belden, Inc.	3.38%	07/15/2027	EUR 700	687,040	0.0
Belden, Inc.	3.38%	07/15/2031	19,101	17,431,729	0.1
				<u>18,702,309</u>	<u>0.1</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
ADT Security Corp. (The)	4.13%	08/01/2029	USD 3,000	2,580,612	0.0
ADT Security Corp. (The)	4.88%	07/15/2032	1,011	867,236	0.0
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	6.00%	06/01/2029	13,593	10,196,302	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	6.63%	07/15/2026	22,051	20,960,693	0.2
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	9.75%	07/15/2027	20,978	19,250,291	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL	4.63%	06/01/2028	1,098	903,289	0.0
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL	4.88%	06/01/2028	GBP 8,760	8,529,463	0.1
ANGI Group LLC	3.88%	08/15/2028	USD 16,913	13,021,995	0.1
APCOA Parking Holdings GmbH	4.63%	01/15/2027	EUR 7,736	7,024,709	0.1
Aptim Corp.	7.75%	06/15/2025	USD 33,081	23,474,932	0.2
APX Group, Inc.	5.75%	07/15/2029	18,741	15,688,163	0.1
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027	5,881	5,676,927	0.0
Aramark Services, Inc.....	5.00%	02/01/2028	1,538	1,414,655	0.0
Aramark Services, Inc.....	6.38%	05/01/2025	18,566	18,471,906	0.1
Arena Luxembourg Finance SARL	1.88%	02/01/2028	EUR 700	592,538	0.0
Block, Inc.	3.50%	06/01/2031	USD 2,795	2,258,881	0.0
Cars.com, Inc.	6.38%	11/01/2028	16,622	15,250,640	0.1
Garda World Security Corp.....	4.63%	02/15/2027	6,747	5,996,286	0.0
Garda World Security Corp.....	7.75%	02/15/2028	2,598	2,549,297	0.0
Garda World Security Corp.....	9.50%	11/01/2027	16,407	15,823,853	0.1
ION Trading Technologies SARL	5.75%	05/15/2028	8,833	7,212,608	0.1
Millennium Escrow Corp.	6.63%	08/01/2026	30,817	20,501,892	0.2
MPH Acquisition Holdings LLC	5.50%	09/01/2028	25,663	19,391,575	0.1
Neptune Bidco US, Inc.	9.29%	04/15/2029	51,848	49,050,702	0.4
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	3.38%	08/31/2027	1,077	935,744	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.75%	04/15/2026	3,000	2,897,009	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	6.25%	01/15/2028	53,628	49,739,078	0.4
Q-Park Holding I BV	1.50%	03/01/2025	EUR 569	552,356	0.0
Q-Park Holding I BV	2.00%	03/01/2027	926	818,547	0.0
Sabre GLBL, Inc.....	7.38%	09/01/2025	USD 17,465	16,412,655	0.1
Sabre GLBL, Inc.....	9.25%	04/15/2025	14,443	14,212,186	0.1
Sabre GLBL, Inc.....	11.25%	12/15/2027	11,669	11,653,634	0.1
TripAdvisor, Inc.	7.00%	07/15/2025	15,163	15,217,215	0.1
Verscend Escrow Corp.	9.75%	08/15/2026	56,709	57,026,071	0.4
WASH Multifamily Acquisition, Inc.	5.75%	04/15/2026	5,687	5,292,430	0.0
ZipRecruiter, Inc.....	5.00%	01/15/2030	38,627	32,441,130	0.2
				<u>493,887,500</u>	<u>3.5</u>
TECHNOLOGIE					
Ahead DB Holdings LLC	6.63%	05/01/2028	21,260	17,943,440	0.1
AthenaHealth Group, Inc.	6.50%	02/15/2030	26,894	21,385,343	0.1
Boxer Parent Co., Inc.	7.13%	10/02/2025	18,204	18,065,936	0.1
Cablevision Lightpath LLC	5.63%	09/15/2028	16,278	12,111,788	0.1
Centurion Bidco SpA	5.88%	09/30/2026	EUR 7,714	7,320,366	0.1
Clarivate Science Holdings Corp.	4.88%	07/01/2029	USD 9,245	7,984,100	0.1
CommScope, Inc.....	6.00%	03/01/2026	19,378	18,670,094	0.1
Dell International LLC/EMC Corp.....	5.85%	07/15/2025	9,315	9,378,893	0.1
Entegris Escrow Corp.....	5.95%	06/15/2030	15,018	14,004,902	0.1
Gen Digital, Inc.....	6.75%	09/30/2027	21,915	21,549,652	0.2
Gen Digital, Inc.....	7.13%	09/30/2030	19,915	19,412,453	0.1
GoTo Group, Inc.....	5.50%	09/01/2027	31,907	15,298,689	0.1
NCR Corp.....	5.00%	10/01/2028	3,000	2,599,351	0.0
NCR Corp.....	5.75%	09/01/2027	11,714	11,400,770	0.1
NCR Corp.....	6.13%	09/01/2029	11,508	11,188,596	0.1
Playtika Holding Corp.	4.25%	03/15/2029	8,973	7,352,046	0.1
Presidio Holdings, Inc.....	4.88%	02/01/2027	15,730	14,357,330	0.1
Presidio Holdings, Inc.....	8.25%	02/01/2028	37,003	35,458,561	0.2
Rackspace Technology Global, Inc.....	3.50%	02/15/2028	30,657	18,642,232	0.1
Science Applications International Corp.	4.88%	04/01/2028	2,038	1,864,608	0.0
Seagate HDD Cayman	4.09%	06/01/2029	25,862	22,251,010	0.2
Seagate HDD Cayman	4.88%	06/01/2027	11,014	10,372,806	0.1
TeamSystem SpA	3.50%	02/15/2028	EUR 1,896	1,781,519	0.0
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.....	7.50%	09/01/2025	USD 72,383	55,755,591	0.4

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Virtusa Corp.	7.13%	12/15/2028	USD 17,654	\$ 14,718,785	0.1%
				<u>390,868,861</u>	<u>2.8</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Air Canada	3.88%	08/15/2026	6,507	5,873,248	0.0
Allegiant Travel Co.	7.25%	08/15/2027	9,128	8,968,260	0.1
American Airlines, Inc./AAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.50%	04/20/2026	21,831	21,284,463	0.2
American Airlines, Inc./AAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.75%	04/20/2029	20,260	19,250,134	0.1
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd./ HawaiianMiles Loyalty Ltd.	5.75%	01/20/2026	17,643	16,404,047	0.1
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.	8.00%	09/20/2025	12,959	13,011,343	0.1
United Airlines, Inc.	4.63%	04/15/2029	5,072	<u>4,503,633</u>	<u>0.0</u>
				<u>89,295,128</u>	<u>0.6</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Albion Financing 1 SARL/Aggreko Holdings, Inc.	5.25%	10/15/2026	EUR 19,265	18,633,133	0.1
Albion Financing 1 SARL/Aggreko Holdings, Inc.	6.13%	10/15/2026	USD 16,653	14,921,907	0.1
Atlantia SpA.	1.88%	02/12/2028	EUR 7,906	7,051,742	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.38%	03/01/2029	USD 18,361	16,628,333	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.75%	07/15/2027	32,463	30,651,457	0.2
BCP V Modular Services Finance II PLC	4.75%	11/30/2028	EUR 3,816	3,471,899	0.0
BCP V Modular Services Finance PLC	6.75%	11/30/2029	31,430	26,666,406	0.2
Hertz Corp. (The)	4.63%	12/01/2026	USD 32,802	29,400,421	0.2
Hertz Corp. (The)	5.00%	12/01/2029	19,540	16,220,036	0.1
Loxam SAS	2.88%	04/15/2026	EUR 9,496	9,043,770	0.1
Loxam SAS	3.75%	07/15/2026	6,434	6,248,100	0.0
PROG Holdings, Inc.	6.00%	11/15/2029	USD 25,181	<u>21,404,562</u>	<u>0.2</u>
				<u>200,341,766</u>	<u>1.4</u>
				<u>5,856,650,403</u>	<u>41.8</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Ally Financial, Inc., Series C(d)	4.70%	05/15/2028	16,427	12,086,768	0.1
Bread Financial Holdings, Inc.	4.75%	12/15/2024	24,532	22,731,279	0.1
Bread Financial Holdings, Inc.	7.00%	01/15/2026	11,510	10,775,395	0.1
Citizens Financial Group, Inc., Series B(d)	6.00%	07/06/2023	8,895	8,612,083	0.1
Credit Suisse Group AG(d)	6.25%	12/18/2024	31,464	25,939,014	0.2
Credit Suisse Group AG(d)	7.50%	07/17/2023	34,938	30,607,717	0.2
Credit Suisse Group AG(d)	7.50%	12/11/2023	10,650	9,750,947	0.1
Credit Suisse Group AG(d)	9.75%	06/23/2027	1,147	1,030,812	0.0
Societe Generale SA(d)	8.00%	09/29/2025	26,752	<u>26,663,917</u>	<u>0.2</u>
				<u>148,197,932</u>	<u>1.1</u>
MAKLER					
Advisor Group Holdings, Inc.	10.75%	08/01/2027	27,269	28,155,243	0.2
AG Issuer LLC	6.25%	03/01/2028	9,943	9,310,541	0.1
AG TTMT Escrow Issuer LLC	8.63%	09/30/2027	13,835	14,038,825	0.1
Jane Street Group/JSG Finance, Inc.	4.50%	11/15/2029	17,256	15,134,535	0.1
NFP Corp.	4.88%	08/15/2028	180	158,032	0.0
NFP Corp.	6.88%	08/15/2028	30,102	25,630,672	0.2
NFP Corp.	7.50%	10/01/2030	17,638	<u>16,824,617</u>	<u>0.1</u>
				<u>109,252,465</u>	<u>0.8</u>
FINANZEN					
Aircastle Ltd.(d)	5.25%	06/15/2026	24,017	19,408,951	0.1
Castlelake Aviation Finance DAC	5.00%	04/15/2027	10,157	9,133,560	0.1
CNG Holdings, Inc.	12.50%	06/15/2024	17,033	14,251,369	0.1
Compass Group Diversified Holdings LLC	5.25%	04/15/2029	23,935	21,012,165	0.2
Curo Group Holdings Corp.	7.50%	08/01/2028	49,329	20,761,463	0.2
Enova International, Inc.	8.50%	09/01/2024	6,350	6,262,711	0.0
Enova International, Inc.	8.50%	09/15/2025	32,666	31,345,781	0.2
goeasy Ltd.	5.38%	12/01/2024	13,174	12,563,461	0.1
ILFC E-Capital Trust I(e)	6.29%	12/21/2065	9,500	6,496,570	0.0
Jefferies Finance LLC/JFIN Co-Issuer Corp.	5.00%	08/15/2028	30,217	25,592,975	0.2
Navient Corp.	4.88%	03/15/2028	7,305	6,213,080	0.0
Navient Corp.	5.00%	03/15/2027	9,095	8,072,618	0.1
Navient Corp.	5.88%	10/25/2024	1,000	973,187	0.0
Navient Corp.	6.75%	06/25/2025	9,594	9,459,576	0.1
Navient Corp.	6.75%	06/15/2026	8,393	8,135,942	0.1
Navient Corp.	7.25%	09/25/2023	182	182,472	0.0
OneMain Finance Corp.	6.88%	03/15/2025	6,000	5,882,371	0.0
SLM Corp.	3.13%	11/02/2026	1,000	862,693	0.0
Springleaf Finance Corp.	7.13%	03/15/2026	3,000	2,932,811	0.0
Synchrony Financial	7.25%	02/02/2033	23,794	<u>22,849,854</u>	<u>0.2</u>
				<u>232,393,610</u>	<u>1.7</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VERSICHERUNGEN					
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.....	6.00%	08/01/2029	USD 2,239	\$ 1,833,478	0.0%
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.....	7.00%	11/15/2025	24,764	23,269,438	0.2
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.....	10.13%	08/01/2026	19,929	19,910,667	0.1
AmWINS Group, Inc.	4.88%	06/30/2029	8,871	7,571,094	0.1
Ardonagh Midco 2 PLC(a)	11.50%	01/15/2027	39,296	37,215,596	0.2
AssuredPartners, Inc.....	5.63%	01/15/2029	17,645	14,989,586	0.1
				<u>104,789,859</u>	<u>0.7</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
Altice France Holding SA	10.50%	05/15/2027	16,348	13,491,652	0.1
Armor Holdco, Inc.	8.50%	11/15/2029	31,547	26,859,396	0.1
Coinbase Global, Inc.....	3.63%	10/01/2031	22,357	13,416,284	0.1
Intrum AB	3.50%	07/15/2026	EUR 16,915	15,554,311	0.1
Intrum AB	4.88%	08/15/2025	10,509	10,458,960	0.1
Motion Finco SARL	7.00%	05/15/2025	8,973	9,636,724	0.1
				<u>89,417,327</u>	<u>0.6</u>
REITs					
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	4.50%	04/01/2027	USD 26,418	22,621,710	0.1
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	5.75%	05/15/2026	8,837	8,137,943	0.1
Iron Mountain UK PLC.....	3.88%	11/15/2025	GBP 1,000	1,136,038	0.0
Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2027	USD 1,028	950,086	0.0
Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2029	13,788	12,056,650	0.1
Iron Mountain, Inc.	5.00%	07/15/2028	10,641	9,642,153	0.1
Iron Mountain, Inc.	5.25%	03/15/2028	2,653	2,441,865	0.0
Vivion Investments SARL.....	3.00%	08/08/2024	EUR 14,300	12,498,054	0.1
Vivion Investments SARL.....	3.50%	11/01/2025	300	241,320	0.0
				<u>69,725,819</u>	<u>0.5</u>
				<u>753,777,012</u>	<u>5.4</u>
VERSORGBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Calpine Corp.....	4.50%	02/15/2028	USD 1,000	900,442	0.0
Calpine Corp.....	4.63%	02/01/2029	1,000	843,062	0.0
Calpine Corp.....	5.00%	02/01/2031	2,000	1,644,974	0.0
Calpine Corp.....	5.13%	03/15/2028	17,753	15,745,296	0.1
Calpine Corp.....	5.25%	06/01/2026	661	633,745	0.0
NRG Energy, Inc.....	3.88%	02/15/2032	15,420	11,953,448	0.1
NRG Energy, Inc.....	6.63%	01/15/2027	334	333,450	0.0
Vistra Corp.(d)	7.00%	12/15/2026	14,856	13,909,436	0.1
Vistra Corp.(d)	8.00%	10/15/2026	17,732	17,093,443	0.1
Vistra Operations Co. LLC	4.38%	05/01/2029	802	693,536	0.0
				<u>63,750,832</u>	<u>0.4</u>
ERDGAS					
AmeriGas Partners LP/AmeriGas Finance Corp.	5.75%	05/20/2027	3,071	2,841,084	0.1
AmeriGas Partners LP/AmeriGas Finance Corp.	5.88%	08/20/2026	2,288	2,157,532	0.0
UGI International LLC	2.50%	12/01/2029	EUR 2,991	2,500,770	0.0
				<u>7,499,386</u>	<u>0.1</u>
SONSTIGE VERSORGBETRIEBE					
Solaris Midstream Holdings LLC	7.63%	04/01/2026	USD 8,515	8,414,352	0.1
				<u>79,664,570</u>	<u>0.6</u>
				<u>6,690,091,985</u>	<u>47.8</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Ally Financial, Inc.	6.70%	02/14/2033	9,759	9,245,474	0.1
Ally Financial, Inc.	8.00%	11/01/2031	41,851	45,299,638	0.4
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series 9(d).....	6.50%	03/05/2025	41,600	39,728,000	0.3
Bank of America Corp., Series B.....	8.05%	06/15/2027	32,004	34,086,487	0.2
Bank of America Corp., Series X(d)	6.25%	09/05/2024	4,224	4,210,223	0.0
Barclays PLC(d).....	7.13%	06/15/2025	GBP 6,422	7,431,539	0.1
Barclays PLC(d).....	7.25%	03/15/2023	5,167	6,219,720	0.0
Barclays PLC(d).....	8.00%	03/15/2029	USD 24,360	23,772,479	0.2
Barclays PLC(d).....	8.88%	09/15/2027	GBP 7,438	9,012,642	0.1
BNP Paribas SA(d)	7.75%	08/16/2029	USD 17,116	17,422,315	0.1
CaixaBank SA(d).....	5.88%	10/09/2027	EUR 200	193,030	0.0
Capital One Financial Corp.	5.82%	02/01/2034	USD 17,444	16,939,023	0.1
Citigroup, Inc.(d)	3.88%	02/18/2026	8,826	7,917,887	0.1
Citigroup, Inc.(d) (e)	8.87%	04/30/2023	13,833	13,908,411	0.1
Citigroup, Inc., Series V(d)	4.70%	01/30/2025	8,408	7,686,313	0.1
Citigroup, Inc., Series W(d).....	4.00%	12/10/2025	7,221	6,593,668	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Citigroup, Inc., Series Y(d)	4.15%	11/15/2026	USD 14,900	\$ 12,806,083	0.1%
Commerzbank AG	8.13%	09/19/2023	1,629	1,636,345	0.0
Credit Agricole SA(d)	8.13%	12/23/2025	14,131	14,274,006	0.1
Credit Agricole SA(d)	8.13%	03/23/2171	21,632	21,897,426	0.2
Dresdner Funding Trust I	8.15%	06/30/2031	5,173	5,563,813	0.0
Erste Group Bank AG(d)	6.50%	04/15/2024	EUR 10,600	10,929,819	0.1
First-Citizens Bank & Trust Co.	3.93%	06/19/2024	USD 6,749	6,701,583	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(c) (d)	7.73%	03/31/2023	14,626	14,474,234	0.1
HSBC Holdings PLC(d)	4.75%	07/04/2029	EUR 9,250	8,464,086	0.1
HSBC Holdings PLC	4.76%	03/29/2033	USD 15,807	14,149,185	0.1
HSBC Holdings PLC(d)	6.00%	09/29/2023	EUR 6,504	6,856,991	0.1
HSBC Holdings PLC(d)	6.38%	03/30/2025	USD 4,594	4,498,084	0.0
ING Groep NV(d)	6.50%	04/16/2025	24,907	23,851,859	0.2
ING Groep NV(d)	6.75%	04/16/2024	5,795	5,680,948	0.0
Intesa Sanpaolo SpA	5.02%	06/26/2024	10,608	10,228,411	0.1
Intesa Sanpaolo SpA	5.71%	01/15/2026	11,463	11,013,219	0.1
Lloyds Banking Group PLC	3.37%	12/14/2046	4,061	8,464,086	0.0
Lloyds Banking Group PLC(d)	7.50%	06/27/2024	6,268	6,176,591	0.0
Regions Bank/Birmingham AL	6.45%	06/26/2037	28,048	29,125,744	0.2
Santander Holdings USA, Inc.	2.49%	01/06/2028	3,443	3,001,516	0.0
Skandinaviska Enskilda Banken AB(d)	6.88%	06/30/2027	600	588,491	0.0
Societe Generale SA(d)	8.00%	09/29/2025	17,752	17,669,792	0.1
Standard Chartered PLC(c) (d)	6.31%	01/30/2027	16,000	14,227,618	0.1
Standard Chartered PLC(d)	7.75%	04/02/2023	10,925	10,930,094	0.1
Standard Chartered PLC(d)	7.75%	02/15/2172	3,534	3,553,212	0.0
Synchrony Bank	5.63%	08/23/2027	5,468	5,354,232	0.0
UBS Group AG(d)	7.00%	01/31/2024	49,607	49,560,522	0.4
UBS Group AG(d)	7.00%	02/19/2025	32,133	31,983,000	0.2
				<u>597,619,364</u>	<u>4.3</u>
MAKLER					
Charles Schwab Corp. (The), Series G(d)	5.38%	06/01/2025	12,288	12,189,391	0.1
FINANZEN					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.30%	01/30/2032	11,208	8,973,309	0.1
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.88%	01/23/2028	6,059	5,482,107	0.1
Aircastle Ltd.	2.85%	01/26/2028	5,211	4,428,044	0.0
Aircastle Ltd.	4.25%	06/15/2026	648	614,047	0.0
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	42,255	41,329,045	0.3
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	1,558	1,375,281	0.0
Aviation Capital Group LLC	1.95%	09/20/2026	3,550	3,056,221	0.0
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	5,788	5,080,196	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	7,715	7,239,879	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	5,387	5,138,890	0.0
				<u>82,717,019</u>	<u>0.6</u>
VERSICHERUNGEN					
Allstate Corp. (The)	6.50%	05/15/2057	39,949	38,755,104	0.3
Aon Corp.	8.21%	01/01/2027	13,915	14,448,974	0.1
Hartford Financial Services Group, Inc. (The), Series ICON(c)	6.99%	02/12/2047	10,000	8,673,814	0.1
Liberty Mutual Group, Inc.	3.63%	05/23/2059	EUR 1,111	1,099,535	0.0
Liberty Mutual Group, Inc.	7.80%	03/15/2037	USD 33,248	36,428,069	0.3
MetLife Capital Trust IV	7.88%	12/15/2037	7,000	7,549,352	0.1
MetLife, Inc.	10.75%	08/01/2039	16,185	21,812,889	0.1
Nationwide Financial Services, Inc.	6.75%	05/15/2037	3,000	2,976,687	0.0
Nationwide Mutual Insurance Co.(c)	7.06%	12/15/2024	5,000	5,002,915	0.0
Nationwide Mutual Insurance Co.	9.38%	08/15/2039	22,662	30,262,296	0.2
Prudential Financial, Inc.	5.63%	06/15/2043	13,127	13,080,960	0.1
Transatlantic Holdings, Inc.	8.00%	11/30/2039	14,148	17,798,966	0.1
				<u>197,889,561</u>	<u>1.4</u>
REITs					
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	4.63%	08/01/2029	3,685	2,755,597	0.0
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.00%	10/15/2027	2,644	2,182,754	0.0
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	4.13%	08/15/2030	3,000	2,607,460	0.0
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	4.63%	06/15/2025	4,985	4,790,733	0.1
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	5.63%	05/01/2024	3,667	3,641,099	0.0
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	5.75%	02/01/2027	2,493	2,432,157	0.0
				<u>18,409,800</u>	<u>0.1</u>
				<u>908,825,135</u>	<u>6.5</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
ArcelorMittal SA	6.75%	03/01/2041	14,928	14,734,735	0.1
ArcelorMittal SA	7.00%	10/15/2039	11,517	11,831,819	0.1
Arconic Corp.	6.00%	05/15/2025	20,000	20,006,581	0.2
Celanese US Holdings LLC	5.90%	07/05/2024	7,027	7,018,378	0.1
Celanese US Holdings LLC	6.05%	03/15/2025	7,027	7,001,127	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
CF Industries, Inc.	4.95%	06/01/2043	USD 20,942	\$ 17,530,567	0.1%
CF Industries, Inc.	5.38%	03/15/2044	14,106	12,449,336	0.1
Freeport-McMoRan, Inc.	5.40%	11/14/2034	11,724	11,078,453	0.1
Freeport-McMoRan, Inc.	5.45%	03/15/2043	16,385	14,831,452	0.1
INEOS Finance PLC	2.88%	05/01/2026	EUR 5,759	5,554,545	0.0
INEOS Finance PLC	3.38%	03/31/2026	3,380	3,276,509	0.0
Olin Corp.	5.00%	02/01/2030	USD 2,728	2,486,338	0.0
Olin Corp.	5.63%	08/01/2029	19,555	18,616,007	0.1
				<u>146,415,847</u>	<u>1.1</u>
INVESTITIONSGÜTER					
General Electric Co., Series D(c) (d)	8.10%	06/15/2023	30,828	30,788,247	0.2
Regal Rexnord Corp.	6.30%	02/15/2030	3,790	3,713,918	0.0
Regal Rexnord Corp.	6.40%	04/15/2033	4,487	4,396,328	0.1
				<u>38,898,493</u>	<u>0.3</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Directv Financing LLC/Directv Financing Co-Obligor, Inc.	5.88%	08/15/2027	34,026	30,523,988	0.2
Netflix, Inc.	4.88%	06/15/2030	1,000	961,596	0.0
Netflix, Inc.	5.88%	11/15/2028	33,984	34,433,236	0.3
				<u>65,918,820</u>	<u>0.5</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Level 3 Financing, Inc.	3.88%	11/15/2029	26,156	19,831,812	0.1
Sprint Capital Corp.	8.75%	03/15/2032	455	541,458	0.0
Sprint LLC	7.13%	06/15/2024	1,000	1,012,825	0.0
Sprint LLC	7.63%	02/15/2025	3,000	3,075,221	0.0
Sprint LLC	7.63%	03/01/2026	8,328	8,646,902	0.1
Sprint LLC	7.88%	09/15/2023	25,000	25,243,600	0.2
				<u>58,351,818</u>	<u>0.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
General Motors Co.	6.25%	10/02/2043	2,398	2,256,849	0.0
General Motors Co.	6.80%	10/01/2027	3,641	3,798,998	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	5.65%	01/17/2029	11,876	11,636,065	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.05%	02/14/2027	7,763	6,962,747	0.1
Lear Corp.	3.50%	05/30/2030	12,304	10,522,257	0.1
				<u>35,176,916</u>	<u>0.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Mattel, Inc.	5.88%	12/15/2027	3,598	3,513,631	0.0
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
International Game Technology PLC	5.25%	01/15/2029	512	474,753	0.0
International Game Technology PLC	6.25%	01/15/2027	9,125	8,936,680	0.1
International Game Technology PLC	6.50%	02/15/2025	7,373	7,394,568	0.1
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	31,126	26,215,304	0.2
Owens Corning	7.00%	12/01/2036	2,898	3,159,748	0.0
PulteGroup, Inc.	6.00%	02/15/2035	615	603,679	0.0
PulteGroup, Inc.	6.38%	05/15/2033	24,025	24,327,482	0.2
PulteGroup, Inc.	7.88%	06/15/2032	16,167	18,049,343	0.1
Resorts World Las Vegas LLC/RWLV Capital, Inc.	4.63%	04/16/2029	3,000	2,369,645	0.0
Sands China Ltd.	3.75%	08/08/2031	1,319	1,038,618	0.0
Sands China Ltd.	4.88%	06/18/2030	4,444	3,862,040	0.0
Sands China Ltd.	5.90%	08/08/2028	2,596	2,447,301	0.0
				<u>98,879,161</u>	<u>0.7</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Macy's Retail Holdings LLC	5.88%	04/01/2029	8,946	8,132,600	0.1
Macy's Retail Holdings LLC	5.88%	03/15/2030	8,853	7,802,314	0.0
Macy's Retail Holdings LLC	6.13%	03/15/2032	3,944	3,397,655	0.0
				<u>19,332,569</u>	<u>0.1</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Charles River Laboratories International, Inc.	3.75%	03/15/2029	1,000	868,634	0.0
Charles River Laboratories International, Inc.	4.25%	05/01/2028	373	336,722	0.0
Newell Brands, Inc.	4.45%	04/01/2026	1,500	1,418,616	0.0
Newell Brands, Inc.	6.38%	09/15/2027	12,585	12,511,987	0.1
Newell Brands, Inc.	6.63%	09/15/2029	15,984	15,846,798	0.1
Pilgrim's Pride Corp.	5.88%	09/30/2027	13,518	13,249,299	0.1
				<u>44,232,056</u>	<u>0.3</u>
ENERGIE					
Antero Resources Corp.	7.63%	02/01/2029	1,453	1,469,182	0.0
Apache Corp.	4.25%	01/15/2030	10,000	8,865,807	0.1
Cenovus Energy, Inc.	6.75%	11/15/2039	2,287	2,388,285	0.0
Continental Resources, Inc./OK	5.75%	01/15/2031	19,163	18,144,847	0.1
Energy Transfer LP	6.25%	04/15/2049	1,000	950,549	0.0
Energy Transfer LP	8.25%	11/15/2029	8,521	9,548,445	0.1
EnLink Midstream LLC.	5.63%	01/15/2028	14,782	14,166,162	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
EnLink Midstream Partners LP	4.15%	06/01/2025	USD 663	\$ 635,787	0.0%
EnLink Midstream Partners LP	5.05%	04/01/2045	12,856	9,873,352	0.1
EnLink Midstream Partners LP	5.45%	06/01/2047	8,848	7,002,151	0.1
EnLink Midstream Partners LP	5.60%	04/01/2044	10,151	8,333,208	0.1
EQT Corp.	3.90%	10/01/2027	10,000	9,163,198	0.1
Hess Corp.	7.30%	08/15/2031	2,953	3,204,715	0.0
Kinder Morgan, Inc.	7.75%	01/15/2032	4,518	5,041,135	0.0
Kinder Morgan, Inc.	7.80%	08/01/2031	18,933	21,039,721	0.2
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026	6,690	6,413,665	0.0
Var Energi ASA	5.00%	05/18/2027	4,700	4,434,737	0.0
Var Energi ASA	7.50%	01/15/2028	5,574	5,748,079	0.0
Western Midstream Operating LP	3.35%	02/01/2025	12,908	12,237,675	0.1
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025	3,698	3,519,434	0.0
Western Midstream Operating LP	4.50%	03/01/2028	13,423	12,391,712	0.1
Western Midstream Operating LP	4.75%	08/15/2028	3,831	3,547,744	0.0
Western Midstream Operating LP	5.45%	04/01/2044	5,469	4,593,342	0.0
				<u>172,712,932</u>	<u>1.2</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Elis SA	1.63%	04/03/2028	EUR 700	632,415	0.0
TECHNOLOGIE					
Dell International LLC/EMC Corp.	8.35%	07/15/2046	USD 2,305	2,626,439	0.0
Nokia Oyj.	6.63%	05/15/2039	2,000	1,951,716	0.0
SK Hynix, Inc.	6.25%	01/17/2026	2,652	2,645,344	0.0
SK Hynix, Inc.	6.38%	01/17/2028	3,806	3,745,104	0.0
SK Hynix, Inc.	6.50%	01/17/2033	4,160	4,080,710	0.1
Western Digital Corp.	2.85%	02/01/2029	837	658,108	0.0
Western Digital Corp.	3.10%	02/01/2032	2,432	1,751,308	0.0
				<u>17,458,729</u>	<u>0.1</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.75%	10/20/2028	17,879	16,896,370	0.1
Mileage Plus Holdings LLC/ Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd.	6.50%	06/20/2027	44,055	44,011,805	0.3
				<u>60,908,175</u>	<u>0.4</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
AerCap Global Aviation Trust	6.50%	06/15/2045	14,021	13,537,994	0.1
				<u>775,969,556</u>	<u>5.5</u>
				<u>1,684,794,691</u>	<u>12.0</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Braskem Idesa SAPI	6.99%	02/20/2032	661	461,048	0.0
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029	24,763	19,129,417	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/10/2028	10,931	9,820,957	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030	6,569	5,514,643	0.0
Braskem Netherlands Finance BV	7.25%	02/13/2033	6,413	6,263,710	0.0
Cia de Minas Buenaventura SAA	5.50%	07/23/2026	14,043	11,798,753	0.1
CSN Inova Ventures	6.75%	01/28/2028	14,737	13,996,245	0.1
CSN Resources SA	4.63%	06/10/2031	9,748	7,637,071	0.1
CSN Resources SA	7.63%	04/17/2026	12,983	12,944,862	0.1
Eldorado Gold Corp.	6.25%	09/01/2029	20,939	18,412,081	0.1
First Quantum Minerals Ltd.	6.88%	10/15/2027	33,725	31,553,953	0.2
First Quantum Minerals Ltd.	7.50%	04/01/2025	10,621	10,307,680	0.1
Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	8.25%	10/22/2025	28,102	27,469,705	0.2
JSW Steel Ltd.	3.95%	04/05/2027	4,086	3,585,465	0.0
JSW Steel Ltd.	5.05%	04/05/2032	795	641,863	0.0
JSW Steel Ltd.	5.95%	04/18/2024	9,640	9,495,400	0.1
Nexa Resources SA	6.50%	01/18/2028	13,920	13,457,995	0.1
OCP SA	3.75%	06/23/2031	7,803	6,291,169	0.1
Sasol Financing USA LLC	5.88%	03/27/2024	9,655	9,516,934	0.1
Stillwater Mining Co.	4.00%	11/16/2026	10,431	9,257,513	0.1
Stillwater Mining Co.	4.50%	11/16/2029	9,575	7,865,264	0.1
Suzano Austria GmbH	3.75%	01/15/2031	4,365	3,672,056	0.0
Suzano Austria GmbH	5.00%	01/15/2030	7,580	6,964,125	0.1
Suzano Austria GmbH, Series DM3N	3.13%	01/15/2032	5,618	4,390,748	0.0
Vedanta Resources Finance II PLC	13.88%	01/21/2024	21,361	17,439,921	0.1
Volcan Cia Minera SAA	4.38%	02/11/2026	5,921	4,596,176	0.0
				<u>272,484,754</u>	<u>2.0</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Cemex SAB de CV(d)	5.13%	06/08/2026	17,508	15,809,724	0.1
Cemex SAB de CV	7.38%	06/05/2027	10,634	10,756,291	0.1
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	26,390	25,123,940	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Embraer Netherlands Finance BV	6.95%	01/17/2028	USD 23,369	\$ 23,164,054	0.2%
IHS Holding Ltd.	5.63%	11/29/2026	7,892	6,694,882	0.0
IHS Holding Ltd.	6.25%	11/29/2028	3,321	2,721,767	0.0
				<u>84,270,658</u>	<u>0.6</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030	20,343	16,430,787	0.1
Telecomunicaciones Digitales SA	4.50%	01/30/2030	463	373,004	0.0
Weibo Corp.	3.38%	07/08/2030	16,775	13,417,903	0.1
				<u>30,221,694</u>	<u>0.2</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
C&W Senior Financing DAC	6.88%	09/15/2027	24,260	21,934,129	0.2
CT Trust	5.13%	02/03/2032	3,214	2,536,736	0.0
Digicel International Finance Ltd./ Digicel international Holdings Ltd.	8.75%	05/25/2024	4,359	3,786,881	0.0
HTA Group Ltd./Mauritius	7.00%	12/18/2025	14,504	13,708,999	0.1
Sable International Finance Ltd.	5.75%	09/07/2027	14,252	13,129,321	0.1
Xiaomi Best Time International Ltd.	3.38%	04/29/2030	1,131	918,938	0.0
				<u>56,015,004</u>	<u>0.4</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
BRF GmbH	4.35%	09/29/2026	12,875	11,179,363	0.1
BRF SA	4.88%	01/24/2030	5,436	4,126,331	0.0
BRF SA	5.75%	09/21/2050	2,952	1,817,879	0.0
Central American Bottling Corp./CBC Bottling Holdco SL/ Beliv Holdco SL	5.25%	04/27/2029	6,201	5,681,666	0.0
MARB BondCo PLC	3.95%	01/29/2031	29,451	21,057,465	0.2
Natura & Co. Luxembourg Holdings SARL	6.00%	04/19/2029	14,595	12,143,040	0.1
Natura Cosméticos SA	4.13%	05/03/2028	10,453	8,116,755	0.1
Rede D'or Finance SARL	4.50%	01/22/2030	9,791	8,237,903	0.1
Rede D'or Finance SARL	4.95%	01/17/2028	6,580	5,958,190	0.0
Ulker Biskuvi Sanayi AS	6.95%	10/30/2025	5,581	4,743,152	0.0
				<u>83,061,744</u>	<u>0.6</u>
ELEKTRIZITÄT					
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027	2,416	2,254,284	0.0
ENERGIE					
Acu Petroleo Luxembourg SARL	7.50%	01/13/2032	9,044	8,157,965	0.1
Cosan SA	5.50%	09/20/2029	13,818	12,460,382	0.1
Ecopetrol SA	4.63%	11/02/2031	8,355	6,165,990	0.0
Ecopetrol SA	5.88%	11/02/2051	6,407	4,089,588	0.0
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	23,645	21,044,050	0.2
Ecopetrol SA	8.88%	01/13/2033	4,242	4,146,555	0.0
Gran Tierra Energy, Inc.	7.75%	05/23/2027	12,019	9,825,168	0.1
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.	5.50%	04/06/2025	19,060	17,937,842	0.1
HPCL-Mittal Energy Ltd.	5.45%	10/22/2026	3,062	2,915,215	0.0
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	6.38%	06/01/2028	1,585	1,477,406	0.0
Kosmos Energy Ltd.	7.50%	03/01/2028	13,719	11,750,324	0.1
Medco Platinum Road Pte Ltd.	6.75%	01/30/2025	4,590	4,496,192	0.0
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034	10,437	9,366,180	0.1
Oleoducto Central SA	4.00%	07/14/2027	3,463	2,970,172	0.0
Peru LNG SRL	5.38%	03/22/2030	18,983	15,020,299	0.1
Raizen Fuels Finance SA	5.30%	01/20/2027	7,683	7,393,927	0.1
ReNew Power Pvt Ltd.	5.88%	03/05/2027	294	279,539	0.0
SEPLAT Energy PLC	7.75%	04/01/2026	17,384	14,624,290	0.1
SierraCol Energy Andina LLC	6.00%	06/15/2028	11,029	8,611,581	0.1
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	3.25%	08/15/2030	19,878	14,908,500	0.1
				<u>177,641,165</u>	<u>1.3</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Bidvest Group UK PLC (The)	3.63%	09/23/2026	7,895	7,005,826	0.1
TECHNOLOGIE					
Baidu, Inc.	3.43%	04/07/2030	304	268,818	0.0
CA Magnum Holdings	5.38%	10/31/2026	36,561	33,361,913	0.2
Lenovo Group Ltd.	3.42%	11/02/2030	2,752	2,245,935	0.0
Lenovo Group Ltd.	5.83%	01/27/2028	11,621	11,409,614	0.1
Lenovo Group Ltd.	6.54%	07/27/2032	6,850	6,662,909	0.0
Xiaomi Best Time International Ltd.	2.88%	07/14/2031	11,245	8,513,168	0.1
				<u>62,462,357</u>	<u>0.4</u>
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN					
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	7,369	6,355,609	0.0
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA	6.75%	03/30/2029	10,660	10,466,787	0.1
JSW Infrastructure Ltd.	4.95%	01/21/2029	2,678	2,293,540	0.0
				<u>12,760,327</u>	<u>0.1</u>
				<u>794,533,422</u>	<u>5.7</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
STAATSANLEIHEN					
ANGOLA					
Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029	USD 32,819	\$ 29,701,195	0.2%
Angolan Government International Bond	9.13%	11/26/2049	38,181	32,358,397	0.2
Angolan Government International Bond	9.38%	05/08/2048	10,509	8,985,195	0.1
				<u>71,044,787</u>	<u>0.5</u>
ARGENTINIEN					
Argentine Republic Government International Bond	0.50%	07/09/2030	12,733	4,125,503	0.0
Argentine Republic Government International Bond	1.00%	07/09/2029	20,068	6,220,931	0.0
Argentine Republic Government International Bond	1.50%	07/09/2035	18,289	5,203,122	0.0
Argentine Republic Government International Bond	3.50%	07/09/2041	30,585	9,603,662	0.1
Argentine Republic Government International Bond	3.88%	01/09/2038	24,411	8,510,213	0.1
				<u>33,663,431</u>	<u>0.2</u>
KOLUMBIEN					
Colombia Government International Bond	4.13%	05/15/2051	12,840	7,469,670	0.0
Colombia Government International Bond	5.63%	02/26/2044	11,709	8,389,499	0.1
Colombia Government International Bond	6.13%	01/18/2041	14,598	11,393,739	0.1
Colombia Government International Bond	7.38%	09/18/2037	13,795	12,767,272	0.1
				<u>40,020,180</u>	<u>0.3</u>
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					
Dominican Republic International Bond	6.00%	07/19/2028	31,995	30,781,190	0.2
Dominican Republic International Bond	7.45%	04/30/2044	17,877	17,114,993	0.2
Dominican Republic International Bond	8.63%	04/20/2027	16,359	17,021,539	0.1
				<u>64,917,722</u>	<u>0.5</u>
ECUADOR					
Ecuador Government International Bond	1.50%	07/31/2040	16,709	5,182,781	0.0
Ecuador Government International Bond	2.50%	07/31/2035	110,730	38,672,384	0.3
Ecuador Government International Bond	5.50%	07/31/2030	18,714	9,033,106	0.1
				<u>52,888,271</u>	<u>0.4</u>
ÄGYPTEN					
Egypt Government International Bond	3.88%	02/16/2026	5,392	4,286,640	0.0
Egypt Government International Bond	5.88%	02/16/2031	1,655	1,100,368	0.0
Egypt Government International Bond	7.30%	09/30/2033	3,437	2,319,975	0.0
Egypt Government International Bond	7.50%	01/31/2027	12,342	10,552,410	0.1
Egypt Government International Bond	7.63%	05/29/2032	43,364	30,620,405	0.2
Egypt Government International Bond	8.50%	01/31/2047	7,580	4,832,250	0.0
Egypt Government International Bond	8.70%	03/01/2049	10,320	6,591,900	0.1
Egypt Government International Bond	8.88%	05/29/2050	22,855	14,627,200	0.1
				<u>74,931,148</u>	<u>0.5</u>
EL SALVADOR					
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	8,560	4,508,980	0.1
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	9,493	4,229,131	0.0
El Salvador Government International Bond	7.63%	02/01/2041	7,141	3,232,641	0.0
El Salvador Government International Bond	7.65%	06/15/2035	9,725	4,490,519	0.0
El Salvador Government International Bond	9.50%	07/15/2052	15,430	7,770,934	0.1
				<u>24,232,205</u>	<u>0.2</u>
GABUN					
Gabon Government International Bond	6.63%	02/06/2031	28,288	22,900,904	0.2
Gabon Government International Bond	6.95%	06/16/2025	17,720	16,989,050	0.1
				<u>39,889,954</u>	<u>0.3</u>
ELFENBEINKÜSTE					
Ivory Coast Government International Bond	4.88%	01/30/2032	EUR 43,563	35,018,204	0.3
Ivory Coast Government International Bond	5.13%	06/15/2025	3,272	3,340,316	0.0
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	USD 8,905	8,415,225	0.1
Ivory Coast Government International Bond	6.88%	10/17/2040	EUR 39,053	30,360,173	0.2
				<u>77,133,918</u>	<u>0.6</u>
KENIA					
Republic of Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027	USD 16,016	14,334,320	0.1
Republic of Kenya Government International Bond	7.25%	02/28/2028	9,643	8,329,141	0.1
				<u>22,663,461</u>	<u>0.2</u>
LIBANON					
Lebanon Government International Bond(f)	1.00%	11/27/2026	10,759	726,233	0.0
Lebanon Government International Bond(f)	6.65%	04/22/2024	4,315	294,768	0.0
Lebanon Government International Bond(f)	6.85%	03/23/2027	5,606	378,405	0.0
				<u>1,399,406</u>	<u>0.0</u>
NIGERIA					
Nigeria Government International Bond	6.13%	09/28/2028	18,454	14,601,727	0.1
Nigeria Government International Bond	7.14%	02/23/2030	10,008	7,718,670	0.0
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047	15,679	10,465,733	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	USD 14,105	\$ 9,801,212	0.1%
Nigeria Government International Bond	7.88%	02/16/2032	17,700	13,584,750	0.1
				<u>56,172,092</u>	<u>0.4</u>
PAKISTAN					
Pakistan Government International Bond	6.88%	12/05/2027	518	227,977	0.0
SENEGAL					
Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	53,439	44,020,376	0.3
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	16,224	11,377,080	0.1
				<u>55,397,456</u>	<u>0.4</u>
SÜDAFRIKA					
Republic of South Africa Government International Bond	5.65%	09/27/2047	8,663	6,302,333	0.0
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	72,740	52,827,425	0.4
Republic of South Africa Government International Bond	6.30%	06/22/2048	1,684	1,324,045	0.0
				<u>60,453,803</u>	<u>0.4</u>
UKRAINE					
Ukraine Government International Bond	7.25%	03/15/2035	17,273	2,934,251	0.0
Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2034	24,077	4,129,205	0.0
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2025	45,102	9,268,461	0.1
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2026	38,721	7,073,843	0.1
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2027	10,000	1,792,500	0.0
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2029	13,037	2,438,734	0.0
Ukraine Government International Bond	9.75%	11/01/2030	9,111	1,690,090	0.0
				<u>29,327,084</u>	<u>0.2</u>
VENEZUELA					
Venezuela Government International Bond(f)	9.00%	05/07/2023	4,270	416,325	0.0
Venezuela Government International Bond(f)	9.25%	09/15/2027	57,269	5,583,728	0.0
				<u>6,000,053</u>	<u>0.0</u>
				<u>710,362,948</u>	<u>5.1</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Absa Group Ltd.(d)	6.38%	05/27/2026	6,561	6,100,910	0.1
BBVA Bancomer SA/Texas	5.88%	09/13/2034	3,720	3,437,047	0.0
				<u>9,537,957</u>	<u>0.1</u>
FINANZEN					
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	4.75%	04/27/2027	4,249	3,665,559	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	3.25%	11/13/2024	2,492	2,289,214	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	3.75%	05/29/2024	1,330	1,252,943	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd.	4.63%	06/03/2026	5,895	5,217,075	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd.	4.88%	11/22/2026	2,841	2,496,174	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd.	5.50%	01/16/2025	13,140	12,382,807	0.1
				<u>27,303,772</u>	<u>0.2</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
OEC Finance Ltd.(a)	4.38%	10/25/2029	3,377	95,905	0.0
OEC Finance Ltd.(a)	5.25%	12/27/2033	3,902	119,003	0.0
OEC Finance Ltd.(a)	7.13%	12/26/2046	38,009	1,284,187	0.0
				<u>1,499,095</u>	<u>0.0</u>
REITs					
China Aoyuan Group Ltd.(g)	5.38%	09/13/2022	206	20,085	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(f)	5.88%	03/01/2027	3,953	375,535	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(f)	5.98%	08/18/2025	1,187	112,765	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(g)	7.95%	02/19/2023	1,954	185,630	0.0
Country Garden Holdings Co., Ltd.	3.13%	10/22/2025	250	160,625	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	4.90%	05/13/2026	923	249,210	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	6.25%	08/10/2024	738	205,164	0.0
Shimao Group Holdings Ltd.(f)	5.20%	01/30/2025	1,488	249,240	0.0
Shimao Group Holdings Ltd.(f)	5.20%	01/16/2027	2,374	397,645	0.0
Shimao Group Holdings Ltd.(f)	5.60%	07/15/2026	1,457	244,047	0.0
Times China Holdings Ltd.(f)	5.55%	06/04/2024	2,944	483,552	0.0
Times China Holdings Ltd.(f)	5.75%	01/14/2027	2,691	427,701	0.0
Times China Holdings Ltd.(f)	6.20%	03/22/2026	328	52,132	0.0
Times China Holdings Ltd.(f)	6.60%	03/02/2023	200	32,100	0.0
Times China Holdings Ltd.(f)	6.75%	07/08/2025	2,003	310,465	0.0
Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030	23,933	20,438,782	0.1
Trust Fibra Uno	6.95%	01/30/2044	3,173	2,743,257	0.0
Yango Justice International Ltd.(f)	7.50%	04/15/2024	1,669	41,725	0.0
Yango Justice International Ltd.(f)	7.50%	02/17/2025	7,440	186,000	0.0
Yango Justice International Ltd.(f)	7.88%	09/04/2024	1,554	38,850	0.0
Yango Justice International Ltd.(f)	8.25%	11/25/2023	1,088	27,200	0.0
Yango Justice International Ltd.(f)	9.25%	04/15/2023	200	5,000	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Yango Justice International Ltd.(g)	10.25%	09/15/2023	USD 628	\$ 15,700	0.0%
				<u>27,002,410</u>	<u>0.1</u>
				<u>65,343,234</u>	<u>0.4</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Adani Green Energy Ltd.	4.38%	09/08/2024	8,794	7,135,781	0.0
AES Andes SA	6.35%	10/07/2019	10,186	9,651,235	0.1
Cometa Energia SA de CV	6.38%	04/24/2035	7,578	7,331,204	0.0
India Clean Energy Holdings	4.50%	04/18/2027	11,748	9,121,588	0.1
Investment Energy Resources Ltd.	6.25%	04/26/2029	8,915	7,962,209	0.1
JSW Hydro Energy Ltd.	4.13%	05/18/2031	2,414	1,977,144	0.0
Light Servicos de Electricidade SA/Light Energia SA	4.38%	06/18/2026	7,767	3,328,160	0.0
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	6.75%	04/24/2033	11,757	11,336,302	0.1
				<u>57,843,623</u>	<u>0.4</u>
				<u>1,628,083,227</u>	<u>11.6</u>
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Bonds	3.00%	08/15/2052	121,586	101,676,042	0.7
U.S. Treasury Bonds(h)	6.75%	08/15/2026	212,755	228,013,533	1.6
U.S. Treasury Notes	0.63%	08/15/2030	200	157,188	0.0
U.S. Treasury Notes(h)	1.88%	02/15/2032	11,538	9,767,638	0.1
U.S. Treasury Notes	2.75%	08/15/2032	74,364	67,520,283	0.5
U.S. Treasury Notes	2.88%	05/15/2032	36,009	33,094,613	0.2
U.S. Treasury Notes(h)	3.13%	08/31/2029	144,922	136,815,614	1.0
U.S. Treasury Notes(h)	3.88%	11/30/2027	95,820	94,427,128	0.7
U.S. Treasury Notes	3.88%	12/31/2027	327,421	322,560,631	2.3
U.S. Treasury Notes	4.13%	11/15/2032	112,398	114,101,324	0.8
U.S. Treasury Notes	4.38%	10/31/2024	147,576	146,169,126	1.1
				<u>1,254,303,120</u>	<u>9.0</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABLE VERZINSLICH					
Bellemeade Re Ltd., Series 2019-4A, Class M2(c)	7.47%	10/25/2029	9,310	9,436,026	0.1
Eagle Re Ltd.					
Series 2019-1, Class M1B(c)	6.42%	04/25/2029	894	893,770	0.0
Series 2020-1, Class M2(c)	6.62%	01/25/2030	10,952	10,587,961	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2015-DNA1, Class B(c)	13.82%	10/25/2027	32,008	33,759,828	0.2
Series 2015-DNA2, Class B(c)	12.16%	12/25/2027	44,918	45,824,864	0.3
Series 2015-DNA3, Class B(c)	13.97%	04/25/2028	15,242	15,926,116	0.1
Series 2015-HQ2, Class B(c)	12.57%	05/25/2025	1,417	1,442,060	0.0
Series 2015-HQA1, Class B(c)	13.41%	03/25/2028	19,265	19,555,004	0.1
Series 2015-HQA2, Class B(c)	15.12%	05/25/2028	10,433	11,332,448	0.1
Series 2016-DNA3, Class B(c)	15.87%	12/25/2028	7,220	7,939,684	0.1
Series 2016-DNA4, Class B(c)	13.22%	03/25/2029	8,682	8,856,588	0.1
Series 2016-HQA1, Class B(c)	17.37%	09/25/2028	16,387	18,605,244	0.1
Series 2016-HQA2, Class B(c)	16.12%	11/25/2028	13,623	15,070,157	0.1
Series 2016-HQA4, Class B(c)	13.37%	04/25/2029	2,288	2,349,848	0.0
Series 2017-DNA3, Class B1(c)	9.06%	03/25/2030	28,000	29,694,986	0.2
Series 2017-HQA3, Class B1(c)	9.06%	04/25/2030	4,415	4,710,154	0.0
Series 2018-DNA2, Class B1(c)	8.32%	12/25/2030	5,829	6,047,111	0.0
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
Series 2016-C01, Class 1B(c)	16.37%	08/25/2028	39,125	44,194,765	0.3
Series 2016-C02, Class 1B(c)	16.87%	09/25/2028	21,415	24,276,720	0.2
Series 2016-C03, Class 1B(c)	16.37%	10/25/2028	7,775	8,732,843	0.1
Series 2016-C03, Class 2B(c)	17.37%	10/25/2028	18,456	21,083,173	0.1
Series 2016-C04, Class 1B(c)	14.86%	01/25/2029	46,083	50,017,154	0.4
Series 2016-C05, Class 2B(c)	15.36%	01/25/2029	36,031	39,234,865	0.3
Series 2016-C06, Class 1B(c)	13.87%	04/25/2029	21,177	22,431,268	0.2
Series 2016-C07, Class 2B(c)	14.12%	05/25/2029	27,685	29,070,616	0.2
Series 2017-C03, Class 1B1(c)	9.47%	10/25/2029	14,858	16,037,530	0.1
Series 2018-C01, Class 1B1(c)	8.17%	07/25/2030	17,488	18,225,847	0.1
Radnor Re Ltd.					
Series 2019-1, Class M2(c)	7.82%	02/25/2029	1,832	1,836,741	0.0
Series 2020-1, Class M2A(c)	6.61%	01/25/2030	11,179	10,963,476	0.1
Series 2020-1, Class M2B(c)	6.87%	01/25/2030	9,514	9,282,441	0.1
				<u>537,419,288</u>	<u>3.8</u>
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 4398, Class IO(i)	6.00%	10/15/2037	19,043	3,473,811	0.1
Series 4976, Class MI(i)	4.50%	05/25/2050	22,003	4,555,089	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 4981, Class MI(i)	5.00%	06/25/2050	USD 33,366	\$ 6,892,366	0.1%
Series 4987, Class IC(i)	4.50%	06/25/2050	75,027	12,908,063	0.1
Series 4993, Class LI(i)	5.00%	07/25/2050	9,152	1,887,057	0.0
Series 5008, Class AI(i)	3.50%	09/25/2050	10,336	1,650,713	0.0
Series 5011, Class MI(i)	3.00%	09/25/2050	10,057	1,598,285	0.0
Series 5013, Class JI(i)	4.00%	09/25/2050	17,015	2,568,172	0.0
Series 5015, Class BI(i)	4.00%	09/25/2050	16,941	3,305,329	0.0
Series 5018, Class AI(i)	4.00%	10/25/2050	9,209	1,700,610	0.0
Series 5018, Class GI(i)	4.50%	10/25/2050	11,884	2,157,222	0.0
Series 5024, Class DI(i)	4.00%	10/25/2050	4,077	709,931	0.0
Series 5030, Class EI(i)	3.50%	10/25/2050	3,844	637,807	0.0
Series 5036, Class IT(i)	4.00%	03/25/2050	4,995	910,020	0.0
Series 5040, Class AI(i)	3.50%	11/25/2050	1,477	244,046	0.0
Series 5043, Class IO(i)	5.00%	11/25/2050	10,373	2,279,852	0.0
Series 5049, Class CI(i)	3.50%	12/25/2050	17,417	3,075,198	0.0
Series 5052, Class IK(i)	4.00%	12/25/2050	15,500	2,834,945	0.0
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2010-109, Class IQ(i)	5.50%	08/25/2040	3,296	336,201	0.0
Series 2013-66, Class LI(i)	7.00%	07/25/2043	10,398	1,745,054	0.0
Series 2015-49, Class LI(i)	5.00%	07/25/2045	10,271	1,850,908	0.0
Series 2016-26, Class IO(i)	5.00%	05/25/2046	10,392	1,616,333	0.0
Series 2019-4, Class AI(i)	6.00%	08/25/2038	17,269	3,279,060	0.0
Series 2020-76, Class GI(i)	4.00%	11/25/2050	11,135	1,988,054	0.0
Series 2020-89, Class KI(i)	4.00%	12/25/2050	51,815	9,768,446	0.1
Series 2020-96, Class KI(i)	2.50%	01/25/2051	5,383	838,678	0.0
Series 2021-18, Class IT(i)	3.00%	04/25/2051	10,442	1,720,836	0.0
Government National Mortgage Association,					
Series 2021-41, Class UI(i)	3.50%	03/20/2051	21,059	3,537,139	0.1
				<u>80,069,225</u>	<u>0.6</u>
VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 4125, Class SA(c) (j)	1.56%	11/15/2042	4,827	451,713	0.0
Series 4248, Class SL(c) (j)	1.46%	05/15/2041	14,258	871,616	0.0
Series 4701, Class NS(c) (j)	1.56%	08/15/2039	5,433	421,389	0.0
Series 4736, Class LS(c) (j)	1.61%	12/15/2047	20,965	2,252,982	0.0
Series 4736, Class SM(c) (j)	1.61%	12/15/2047	42,084	4,175,978	0.1
Series 4774, Class BS(c) (j)	1.61%	02/15/2048	19,191	2,044,737	0.0
Series 4954, Class SL(c) (j)	1.43%	02/25/2050	15,651	1,446,604	0.0
Series 4981, Class HS(c) (j)	1.48%	06/25/2050	48,311	4,222,119	0.1
Series 4981, Class JS(c) (j)	1.48%	06/25/2050	74,779	8,672,646	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2005-91, Class SD(c) (j)	2.08%	10/25/2035	4,140	327,090	0.0
Series 2012-70, Class HS(c) (j)	1.38%	07/25/2042	2,923	307,841	0.0
Series 2013-15, Class SA(c) (j)	1.53%	03/25/2043	12,568	1,218,646	0.0
Series 2015-26, Class SH(c) (j)	1.83%	05/25/2045	4,112	473,825	0.0
Series 2016-64, Class SP(c) (j)	1.38%	09/25/2046	14,324	1,274,585	0.0
Series 2016-89, Class SH(c) (j)	1.38%	12/25/2046	10,770	980,578	0.0
Series 2017-97, Class SW(c) (j)	1.58%	12/25/2047	24,064	2,346,480	0.0
Series 2018-36, Class SG(c) (j)	1.58%	06/25/2048	10,317	1,258,614	0.0
Series 2018-43, Class SB(c) (j)	1.58%	06/25/2048	5,716	588,668	0.0
Series 2019-38, Class SM(c) (j)	1.43%	07/25/2049	4,152	570,470	0.0
Series 2019-65, Class SY(c) (j)	1.43%	11/25/2049	8,825	1,010,966	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2009-76, Class SB(c) (j)	1.51%	09/16/2039	5,054	311,925	0.0
Series 2015-3, Class DS(c) (j)	1.00%	11/20/2041	10,647	152,725	0.0
Series 2017-134, Class MS(c) (j)	1.60%	09/20/2047	5,768	615,464	0.0
Series 2017-161, Class CS(c) (j)	1.65%	10/20/2047	11,461	925,572	0.0
Series 2020-47, Class SG(c) (j)	1.40%	02/20/2049	9,809	801,613	0.0
				<u>37,724,846</u>	<u>0.3</u>
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH					
Alternative Loan Trust					
Series 2006-24CB, Class A16	5.75%	08/25/2036	1,341	755,654	0.0
Series 2006-26CB, Class A6	6.25%	09/25/2036	663	365,576	0.0
Series 2006-26CB, Class A8	6.25%	09/25/2036	2,508	1,383,252	0.0
Series 2006-28CB, Class A14	6.25%	10/25/2036	2,247	1,248,860	0.0
Series 2006-28CB, Class A18	6.00%	10/25/2036	792	426,453	0.0
Series 2006-42, Class A16	6.00%	01/25/2047	2,512	1,503,424	0.0
Series 2006-J5, Class 1A1	6.50%	09/25/2036	1,675	961,165	0.0
Series 2007-15CB, Class A19	5.75%	07/25/2037	1,330	830,713	0.0
Series 2007-16CB, Class 1A7	6.00%	08/25/2037	2,796	2,149,688	0.0
Bear Stearns ARM Trust, Series 2007-4, Class 22A1	3.70%	06/25/2047	5,186	4,631,758	0.1
ChaseFlex Trust, Series 2007-1, Class 1A3	6.50%	02/25/2037	4,264	1,652,914	0.0
CHL Mortgage Pass-Through Trust					
Series 2006-13, Class 1A19	6.25%	09/25/2036	556	233,448	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Series 2007-3, Class A30	5.75%	04/25/2037	USD 1,106	\$ 584,088	0.0%
Series 2007-HY4, Class 1A1	3.63%	09/25/2047	1,669	1,443,507	0.0
Citigroup Mortgage Loan Trust, Series 2007-AR4, Class 1A1A	3.98%	03/25/2037	971	841,204	0.0
CitiMortgage Alternative Loan Trust, Series 2007-A3, Class 1A4	5.75%	03/25/2037	430	374,573	0.0
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust, Series 2006-AA3, Class A1	4.45%	06/25/2036	1,262	998,836	0.0
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust, Series 2007-6XS, Class 2A5S(c)	6.50%	02/25/2047	3,697	1,406,347	0.0
Residential Accredit Loans, Inc. Trust Series 2005-QA10, Class A31	4.57%	09/25/2035	3,382	2,256,683	0.1
Series 2005-QS14, Class 3A1	6.00%	09/25/2035	766	664,172	0.0
Residential Asset Securitization Trust Series 2006-A8, Class 3A4	6.00%	08/25/2036	2,259	1,194,451	0.0
Series 2007-A1, Class A8	6.00%	03/25/2037	3,802	1,343,157	0.0
Series 2007-A5, Class 2A3	6.00%	05/25/2037	993	565,879	0.0
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust, Series 2006-3, Class 3CB4	6.00%	04/25/2036	397	323,965	0.0
				<u>28,139,767</u>	<u>0.2</u>
NICHT STAATLICH VARIABEL VERZINSLICH					
Alternative Loan Trust, Series 2007-7T2, Class A3(c)	5.22%	04/25/2037	6,062	1,988,863	0.0
CHL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2007-13, Class A7(c)	5.22%	08/25/2037	2,038	830,282	0.0
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust, Series 2007-FA2, Class 1A6(c) (j)	0.93%	04/25/2037	1,538	141,838	0.0
Impac Secured Assets Corp., Series 2005-2, Class A2D(c)	5.48%	03/25/2036	1,142	885,321	0.0
Lehman XS Trust Series 2007-10H, Class 2AIO(c) (j)	2.43%	07/25/2037	2,283	188,106	0.0
Series 2007-16N, Class 2A2(c)	6.32%	09/25/2047	1,653	1,381,676	0.0
PHH Alternative Mortgage Trust, Series 2007-2, Class 1A3(c)	5.28%	05/25/2037	874	794,257	0.0
RBSGC Mortgage Loan Trust, Series 2007-B, Class 1A4(c)	5.07%	01/25/2037	798	270,913	0.0
Residential Accredit Loans, Inc. Trust, Series 2006-QS18, Class 2A2(c) (j)	1.93%	12/25/2036	5,587	476,730	0.0
				<u>6,957,986</u>	<u>0.0</u>
				<u>690,311,112</u>	<u>4.9</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB SICAV I - Asia Income Opportunities Portfolio - Class ZT			2,135,482	174,639,677	1.2
AB SICAV I - Emerging Market Corporate Debt Portfolio - Class S			4,017,647	98,392,174	0.7
AB SICAV I - Emerging Market Local Currency Debt Portfolio - Class ZT			4,972,749	44,406,650	0.3
AB SICAV I - Euro High Yield Portfolio - Class S			5,216,996	161,346,808	1.2
AB SICAV I - Financial Credit Portfolio - Class ZT			1,366,420	135,767,464	1.0
AB SICAV I - US High Yield Portfolio - Class ZT			4,755,164	60,675,891	0.4
				<u>675,228,664</u>	<u>4.8</u>
QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
BAHRAIN					
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	7.50%	10/25/2027	USD 4,456	4,585,625	0.0
INDONESIEN					
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	4.75%	05/15/2025	1,131	1,100,067	0.0
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.45%	05/15/2030	1,209	1,192,388	0.0
				<u>2,292,455</u>	<u>0.0</u>
KASACHSTAN					
KazMunayGas National Co. JSC	5.38%	04/24/2030	7,714	6,927,172	0.1
MEXIKO					
Comision Federal de Electricidad	3.35%	02/09/2031	8,446	6,668,645	0.1
Comision Federal de Electricidad	3.88%	07/26/2033	9,050	6,851,416	0.1
Comision Federal de Electricidad	4.69%	05/15/2029	13,455	11,994,291	0.1
Comision Federal de Electricidad	6.13%	06/16/2045	4,500	3,863,812	0.0
Petroleos Mexicanos	5.95%	01/28/2031	62,572	47,682,993	0.3
Petroleos Mexicanos	6.70%	02/16/2032	19,401	15,357,832	0.1
Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047	31,607	20,358,069	0.1
Petroleos Mexicanos	6.95%	01/28/2060	23,631	15,142,154	0.1
				<u>127,919,212</u>	<u>0.9</u>
PANAMA					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	4.00%	08/11/2041	3,367	2,725,797	0.1
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	5.13%	08/11/2061	2,883	2,260,993	0.0
				<u>4,986,790</u>	<u>0.1</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SÜDAFRIKA					
Eskom Holdings SOC Ltd.	7.13%	02/11/2025	USD 7,482	\$ 7,348,072	0.1%
Transnet Soc Ltd.	8.25%	02/06/2028	21,430	21,483,575	0.1
				<u>28,831,647</u>	<u>0.2</u>
TRINIDAD & TOBAGO					
Trinidad Generation UnLtd.	5.25%	11/04/2027	217	211,846	0.0
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE					
DP World Crescent Ltd.	3.88%	07/18/2029	899	835,115	0.0
DP World Ltd./United Arab Emirates	5.63%	09/25/2048	3,782	3,634,975	0.0
DP World Salaam(d)	6.00%	10/01/2025	21,915	21,778,031	0.2
				<u>26,248,121</u>	<u>0.2</u>
VENEZUELA					
Petroleos de Venezuela SA(f)	5.38%	04/12/2027	61,738	2,778,201	0.0
				<u>204,781,069</u>	<u>1.5</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Consolidated Energy Finance SA	5.00%	10/15/2028	EUR 6,188	5,744,452	0.1
Consolidated Energy Finance SA	6.50%	05/15/2026	USD 1,041	988,301	0.0
				<u>6,732,753</u>	<u>0.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Allwyn International AS	3.88%	02/15/2027	EUR 7,626	7,450,986	0.0
Melco Resorts Finance Ltd.	5.38%	12/04/2029	USD 5,214	4,301,550	0.0
Melco Resorts Finance Ltd.	5.63%	07/17/2027	10,154	8,965,982	0.1
Melco Resorts Finance Ltd.	5.75%	07/21/2028	2,757	2,371,020	0.0
MGM China Holdings Ltd.	5.25%	06/18/2025	5,982	5,616,350	0.0
MGM China Holdings Ltd.	5.38%	05/15/2024	8,461	8,219,333	0.1
MGM China Holdings Ltd.	5.88%	05/15/2026	6,242	5,792,576	0.0
Studio City Co., Ltd.	7.00%	02/15/2027	3,664	3,444,160	0.0
Studio City Finance Ltd.	5.00%	01/15/2029	548	421,960	0.0
Studio City Finance Ltd.	6.00%	07/15/2025	9,535	8,598,186	0.1
Studio City Finance Ltd.	6.50%	01/15/2028	10,680	9,029,940	0.1
Wynn Macau Ltd.	4.88%	10/01/2024	1,000	955,000	0.0
Wynn Macau Ltd.	5.13%	12/15/2029	3,667	2,976,687	0.0
Wynn Macau Ltd.	5.50%	01/15/2026	16,527	14,998,253	0.1
Wynn Macau Ltd.	5.50%	10/01/2027	12,252	10,597,980	0.1
Wynn Macau Ltd.	5.63%	08/26/2028	10,091	8,526,895	0.1
				<u>102,266,858</u>	<u>0.7</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV.	4.75%	05/09/2027	20,440	18,421,346	0.1
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV.	5.13%	05/09/2029	20,440	18,092,670	0.1
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV.	7.13%	01/31/2025	21,515	21,609,128	0.2
				<u>58,123,144</u>	<u>0.4</u>
ENERGIE					
Leviathan Bond Ltd.	5.75%	06/30/2023	7,973	7,918,186	0.1
Leviathan Bond Ltd.	6.13%	06/30/2025	7,639	7,394,829	0.0
Leviathan Bond Ltd.	6.50%	06/30/2027	13,968	13,259,868	0.1
				<u>28,572,883</u>	<u>0.2</u>
				<u>195,695,638</u>	<u>1.4</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 9 Ltd., Series 2020-9A, Class E(c)	12.07%	01/20/2034	2,000	1,909,730	0.0
AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class E(c)	10.79%	04/15/2034	5,000	4,453,685	0.0
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class E(c)	11.15%	04/15/2034	4,063	3,645,789	0.0
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class E(c)	10.96%	07/20/2034	2,500	2,223,490	0.0
AGL CLO 13 Ltd., Series 2021-13A, Class E(c)	11.31%	10/20/2034	12,156	10,871,878	0.1
AGL CLO 16 Ltd., Series 2021-16A, Class E(c)	11.66%	01/20/2035	2,900	2,618,561	0.0
AIG CLO Ltd., Series 2021-3A, Class E(c)	11.27%	01/25/2035	7,600	6,653,222	0.1
Apidos CLO XXIII, Series 2015-23A, Class ER(c)	10.99%	04/15/2033	1,752	1,558,497	0.0
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class E(c)	10.56%	04/20/2034	3,000	2,655,540	0.0
Ballyrock CLO 14 Ltd., Series 2020-14A, Class D(c)	11.81%	01/20/2034	1,750	1,583,953	0.0
Ballyrock CLO 17 Ltd., Series 2021-17A, Class D(c)	10.79%	10/20/2034	5,030	4,324,653	0.0
Cedar Funding IX CLO Ltd., Series 2018-9A, Class E(c)	10.16%	04/20/2031	550	473,342	0.0
Dryden 49 Senior Loan Fund, Series 2017-49A, Class E(c)	11.09%	07/18/2030	3,732	3,212,873	0.0
Dryden 57 CLO Ltd., Series 2018-57A, Class E(c)	10.06%	05/15/2031	6,004	5,021,169	0.1
Generate CLO 3 Ltd., Series 3A, Class ER(c)	11.21%	10/20/2029	438	394,349	0.0
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(c)	11.25%	04/15/2034	3,600	3,236,774	0.0
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class ER(c)	10.96%	10/20/2030	7,000	5,986,442	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 Ltd., Series 2018-29A, Class D(c)	7.90%	10/19/2031	3,000	2,803,179	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 Ltd., Series 2019-33A, Class ER(c)	11.04%	10/16/2033	USD 8,200	\$ 7,290,923	0.1%
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 Ltd., Series 2020-39A, Class E(c)	12.01%	01/20/2032	2,250	2,065,723	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 Ltd., Series 2021-42A, Class E(c)	10.74%	07/16/2035	2,750	2,437,100	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 44 Ltd., Series 2021-44A, Class E(c)	10.79%	10/16/2034	750	664,823	0.0
Octagon Investment Partners 30 Ltd., Series 2017-1A, Class D(c)	11.01%	03/17/2030	1,000	833,261	0.0
OZLM XVIII Ltd., Series 2018-18A, Class E(c)	10.33%	04/15/2031	10,000	7,895,960	0.1
OZLM XXII Ltd., Series 2018-22A, Class D(c)	10.09%	01/17/2031	2,933	2,172,055	0.0
Peace Park CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(c)	10.81%	10/20/2034	3,700	3,271,599	0.0
Pikes Peak CLO 7, Series 2021-7A, Class E(c)	11.71%	02/25/2034	3,000	2,670,201	0.0
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class E(c)	11.27%	07/20/2034	8,350	7,325,163	0.1
PPM CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(c)	10.74%	07/15/2031	7,200	5,191,603	0.1
PPM CLO 5 Ltd., Series 2021-5A, Class E(c)	11.29%	10/18/2034	2,050	1,718,691	0.0
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(c)	11.17%	07/20/2034	2,000	1,723,616	0.0
Wehle Park CLO Ltd., Series 2022-1A, Class E(c)	11.40%	04/21/2035	11,890	10,846,308	0.1
				<u>119,734,152</u>	<u>0.9</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E.	4.65%	02/10/2036	11,700	9,687,982	0.1
CCUBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class XA(i)	1.01%	11/15/2050	4,407	152,754	0.0
CFCRE Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C8, Class XA(i)	1.48%	06/15/2050	7,688	364,664	0.0
Citigroup Commercial Mortgage Trust					
Series 2013-GC11, Class XA(i)	0.84%	04/10/2046	260	14	0.0
Series 2014-GC23, Class D	4.48%	07/10/2047	15,574	13,698,356	0.1
Series 2015-GC29, Class XA(i)	1.02%	04/10/2048	27,685	471,402	0.0
Series 2017-P8, Class XA(i)	0.87%	09/15/2050	45,773	1,385,129	0.0
Series 2018-C6, Class XA(i)	0.77%	11/10/2051	3,152	104,571	0.0
Commercial Mortgage Trust					
Series 2010-C1, Class F	4.00%	07/10/2046	3,049	2,744,953	0.0
Series 2012-CR2, Class G	4.25%	08/15/2045	4,120	2,055,212	0.0
Series 2012-CR3, Class XA(i)	1.23%	10/15/2045	5,952	590	0.0
Series 2014-CR15, Class XA(i)	0.62%	02/10/2047	40,055	160,947	0.0
Series 2014-CR16, Class D	4.93%	04/10/2047	20,000	17,173,144	0.2
Series 2014-CR20, Class XA(i)	0.94%	11/10/2047	44,845	536,511	0.0
Series 2016-DC2, Class XA(i)	0.93%	02/10/2049	33,561	717,277	0.0
Series 2017-COR2, Class XA(i)	1.16%	09/10/2050	17,621	705,899	0.0
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2011-GC5, Class D	5.15%	08/10/2044	2,801	1,161,822	0.0
Series 2014-GC18, Class D	5.06%	01/10/2047	2,771	1,039,284	0.0
Series 2017-GS7, Class XA(i)	1.08%	08/10/2050	55,363	2,032,762	0.0
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2013-C14, Class D	4.55%	08/15/2046	3,001	1,303,634	0.0
Series 2013-C15, Class XA(i)	0.98%	11/15/2045	26,701	70,548	0.0
Series 2014-C21, Class XA(i)	0.94%	08/15/2047	52,248	456,709	0.0
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-LC9, Class G	3.78%	12/15/2047	13,837	9,411,088	0.1
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust					
Series 2015-C22, Class XA(i)	1.00%	04/15/2048	64,083	913,491	0.0
Series 2016-C30, Class XA(i)	1.35%	09/15/2049	57,084	2,006,063	0.0
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2016-BNK2, Class XA(i) .	0.96%	11/15/2049	75,003	2,011,042	0.0
UBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2017-C2, Class XA(i)	1.07%	08/15/2050	2,411	89,230	0.0
Series 2018-C10, Class XA(i)	0.87%	05/15/2051	80,568	2,920,554	0.0
Series 2018-C14, Class XA(i)	0.88%	12/15/2051	41,083	1,605,465	0.0
Series 2018-C15, Class XA(i)	0.90%	12/15/2051	66,197	2,602,215	0.0
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust					
Series 2016-C33, Class XA(i)	1.57%	03/15/2059	54,483	2,036,908	0.0
Series 2016-C35, Class XA(i)	1.88%	07/15/2048	4,836	229,782	0.0
Series 2016-LC24, Class XA(i)	1.61%	10/15/2049	78,765	3,425,418	0.1
Series 2017-C38, Class XA(i)	0.97%	07/15/2050	24,051	756,000	0.0
Series 2018-C48, Class XA(i)	1.06%	01/15/2052	28,443	1,158,995	0.0
WF-RBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-C10, Class XA(i)	1.15%	12/15/2045	4,678	436	0.0
Series 2014-C20, Class D	3.99%	05/15/2047	4,799	1,701,952	0.0
				<u>86,892,803</u>	<u>0.6</u>
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS					
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class E(c)	9.59%	05/15/2036	5,780	4,805,760	0.1
				<u>4,805,760</u>	<u>0.1</u>
				<u>91,698,563</u>	<u>0.7</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE					
BAHRAIN					
Bahrain Government International Bond	5.45%	09/16/2032	USD 2,327	\$ 2,094,300	0.0%
Bahrain Government International Bond	5.63%	09/30/2031	6,000	5,542,500	0.0
Bahrain Government International Bond	6.75%	09/20/2029	6,000	5,977,500	0.1
Bahrain Government International Bond	7.38%	05/14/2030	6,009	6,181,759	0.1
				<u>19,796,059</u>	<u>0.2</u>
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					
Dominican Republic International Bond	5.50%	02/22/2029	5,560	5,144,042	0.0
				<u>5,144,042</u>	<u>0.0</u>
OMAN					
Oman Government International Bond	4.75%	06/15/2026	7,017	6,794,649	0.1
Oman Government International Bond	6.25%	01/25/2031	16,311	16,441,488	0.1
Oman Government International Bond	7.00%	01/25/2051	4,424	4,363,170	0.0
				<u>27,599,307</u>	<u>0.2</u>
				<u>52,539,408</u>	<u>0.4</u>
STAMMAKTIE					
Battalion Oil Corp.			393	3,541	0.0
Berry Corp.			740,000	6,978,200	0.1
Civitas Resources, Inc.			90,161	6,326,597	0.1
Denbury, Inc.			143,002	11,922,077	0.1
Diamond Offshore Drilling, Inc.			526,435	6,254,048	0.0
iHeartMedia, Inc. - Class A			542,779	3,940,575	0.0
Intelsat SA/Luxembourg			359,729	8,476,294	0.1
Mallinckrodt PLC			80,262	745,634	0.0
Paysafe Ltd.			134,790	2,687,713	0.0
SandRidge Energy, Inc.			3,888	56,726	0.0
				<u>47,391,405</u>	<u>0.4</u>
SCHWELLENMÄRKTE – LOKALE WÄHRUNG					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
HDFC Bank Ltd.	8.10%	03/22/2025	INR 1,070,000	12,518,712	0.1
INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE					
KOLUMBIEN					
Fideicomiso PA Costera	6.25%	01/15/2034	COP 18,690,784	3,486,904	0.0
				<u>16,005,616</u>	<u>0.1</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN					
VEREINIGTE STAATEN					
Wisconsin Public Finance Authority, Series 2021	5.75%	07/25/2041	USD 15,000	13,385,157	0.1
VORZUGSAKTIE					
INDUSTRIE					
ENERGIE					
Gulfport Energy Corp.(a) (d)	10.00%		2,647	11,911,500	0.1
VERSORGBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Vistra Energy Corp.(d)	0.00%		454,387	530,270	0.0
				<u>12,441,770</u>	<u>0.1</u>
				<u>13,376,485,577</u>	<u>95.7</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
SNS Bank NV, Series E(d) (k)	11.25%	12/31/2049	EUR 7,579	0	0.0
MAKLER					
Hightower Holding LLC	6.75%	04/15/2029	USD 27,389	23,319,033	0.1
REITs					
Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/ PK Finance Co-Issuer	4.88%	05/15/2029	9,031	7,554,447	0.1
				<u>30,873,480</u>	<u>0.2</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Magnetation LLC/Mag Finance Corp.(g) (k)	11.00%	05/15/2018	40,106	0	0.0
Mercer International, Inc.	5.13%	02/01/2029	20,091	16,484,980	0.1
				<u>16,484,980</u>	<u>0.1</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Lamar Media Corp.	4.88%	01/15/2029	USD 2,301	\$ 2,137,286	0.0%
Liberty Interactive LLC(b)	3.75%	02/15/2030	11,893	3,718,566	0.1
National CineMedia LLC	5.75%	08/15/2026	6,800	131,235	0.0
				<u>5,987,087</u>	<u>0.1</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Intelsat Jackson Holdings SA(k)	5.50%	08/01/2023	33,777	0	0.0
Intelsat Jackson Holdings SA(k)	8.50%	10/15/2024	2,575	0	0.0
Intelsat Jackson Holdings SA(k)	9.75%	07/15/2025	2,000	0	0.0
				<u>0</u>	<u>0.0</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Exide Technologies, (Exchange Priority)(k)	11.00%	10/31/2024	27,457	0	0.0
Exide Technologies, (First Lien)(k)	11.00%	10/31/2024	11,269	0	0.0
PM General Purchaser LLC	9.50%	10/01/2028	25,274	23,071,259	0.2
Real Hero Merger Sub 2, Inc.	6.25%	02/01/2029	17,634	13,085,380	0.1
				<u>36,156,639</u>	<u>0.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Royal Caribbean Cruises Ltd.	11.50%	06/01/2025	28,450	30,221,581	0.2
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
ModivCare, Inc.	5.88%	11/15/2025	3,735	3,523,757	0.0
ENERGIE					
Gulfport Energy Corp.	6.00%	10/15/2024	24,233	15,267	0.0
Gulfport Energy Corp.	6.38%	05/15/2025	28,214	17,775	0.0
Gulfport Energy Corp.	6.38%	01/15/2026	20,769	13,085	0.0
Gulfport Energy Corp.	6.63%	05/01/2023	3,218	2,027	0.0
New Fortress Energy, Inc.	6.75%	09/15/2025	21,236	19,898,277	0.1
PDC Energy, Inc.	6.13%	09/15/2024	6,662	6,604,217	0.1
				<u>26,550,648</u>	<u>0.2</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Korn Ferry	4.63%	12/15/2027	17,280	15,989,667	0.1
Monitronics International, Inc.(k)	9.13%	04/01/2023	21,822	0	0.0
MPH Acquisition Holdings LLC	5.75%	11/01/2028	59,950	38,979,647	0.3
				<u>54,969,314</u>	<u>0.4</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.	8.00%	09/20/2025	17,117	17,183,955	0.1
				<u>191,077,961</u>	<u>1.4</u>
				<u>221,951,441</u>	<u>1.6</u>
STAMMAKTIE					
AG Tracker (k)			1,148,905	1	0.0
ATD New Holdings, Inc.			525,684	34,169,460	0.3
BIS Industries Holdings Ltd. (k)			10,224,003	10	0.0
Carlson Travel, Inc.			542,258	5,422,580	0.0
CHC Group LLC			262,557	394	0.0
Exide Corp. (k)			6,006	2,102,100	0.0
GOLO Mobile, Inc. (k)			485,119	0	0.0
Intelsat Jackson Holdings SA (k)			75,344	0	0.0
K201640219 South Africa Ltd. A Shares (k)			193,371,375	193	0.0
K201640219 South Africa Ltd. B Shares (k)			30,622,211	31	0.0
Monitronics International, Inc.			407,250	81	0.0
Mt Logan Re Ltd. (Special Investment) (k)			10,454	9,034,563	0.0
New Cotai LLC/New Cotai Capital Corp. (k)			63	0	0.0
Southeastern Grocers, Inc. (k)			2,258,161	50,808,623	0.4
				<u>101,538,036</u>	<u>0.7</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
Commercial Mortgage Trust, Series 2012-CR3, Class F(c)	4.75%	10/15/2045	USD 3,626	725,421	0.0
Grantor Trust CGCMT, Series 2015-P1X(k)	4.49%	09/15/2048	555	15,650,653	0.2
Grantor Trust COMM, Series 2014-UBS2(k)	0.00%	03/10/2047	469	6,471,695	0.0
Grantor Trust CSAIL, Series 2015-C1(k)	4.00%	04/15/2050	1,006	12,433,217	0.1
Grantor Trust JPMBB, Series 2014-C24(k)	4.00%	11/15/2047	1,109	4,689,597	0.0
Grantor Trust WFRBS, Series 2014-C23(k)	3.40%	10/15/2057	581	10,826,471	0.0
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2013-GC13(k)	3.49%	10/07/2046	610	8,977,777	0.0
Series 2013-GC17(k)	0.00%	10/11/2046	841	14,256,220	0.2
				<u>74,031,051</u>	<u>0.5</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN					
VEREINIGTE STAATEN					
State of California, Series 2010	7.60%	11/01/2040	5,645	7,282,248	0.1
State of Illinois, Series 2010	7.35%	07/01/2035	19,732	21,469,317	0.1
				<u>28,751,565</u>	<u>0.2</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
SCHWELLENMÄRKTE – LOKALE WÄHRUNG					
INFLATIONSGEKÜPTE WERTPAPIERE					
KOLUMBIEN					
Fideicomiso PA Pacifico Tres	7.00%	01/15/2035	COP 97,872,936	\$ 17,623,223	0.1%
INDUSTRIE					
K201640219 South Africa Ltd. (k)	0.00%	06/25/2023	ZAR 1,003	0	0.0
				<u>17,623,223</u>	<u>0.1</u>
VORZUGSAKTIE					
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Exide International Holdings LP(k)	0.00%		21,353	15,480,925	0.1
ENERGIE					
Gulfport Energy Corp.	10.00%		114	513,000	0.0
				<u>15,993,925</u>	<u>0.1</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
INDUSTRIE					
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
BBFI Liquidating Trust(d) (k)	0.00%	12/30/2099	USD 19,467	8,273,132	0.1
Tonon Luxembourg SA(f) (k)	6.50%	10/31/2024	4,691	469	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(g) (k)	10.50%	01/28/2018	27,458	2,746	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(g) (k)	10.88%	01/13/2020	8,270	827	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(g) (k)	11.75%	02/09/2022	32,498	3,250	0.0
				<u>8,280,424</u>	<u>0.1</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
VTR Finance NV	6.38%	07/15/2028	2,602	1,117,559	0.0
INVESTITIONSGÜTER					
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	25,375	36,477	0.0
				<u>9,434,460</u>	<u>0.1</u>
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE					
PAKISTAN					
Pakistan Government International Bond	7.38%	04/08/2031	8,716	3,748,839	0.0
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Terraform Global Operating LP	6.13%	03/01/2026	2,777	2,663,145	0.0
				<u>15,846,444</u>	<u>0.1</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
Elmwood CLO 15 Ltd., Series 2022-2A, Class E(c)	11.90%	04/22/2035	4,200	3,955,530	0.0
Pikes Peak CLO 10, Series 2022-10A, Class E(c)	12.58%	04/22/2034	6,150	5,846,141	0.1
				<u>9,801,671</u>	<u>0.1</u>
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAATSANLEIHEN					
UKRAINE					
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC(g)	7.38%	09/15/2022	10,054	2,293,569	0.0
State Agency of Roads of Ukraine	6.25%	06/24/2030	35,107	6,084,482	0.1
State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 PLC	9.63%	03/20/2025	2,349	1,352,698	0.0
				<u>9,730,749</u>	<u>0.1</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Lloyds Banking Group PLC(d)	6.00%	06/07/2032	GBP 4,459	4,936,085	0.0
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I					
Series 2019-24, Class PT.	11.35%	08/15/2044	USD 783	758,937	0.0
Series 2019-43, Class PT.	(14.91)%	11/15/2044	14	13,591	0.0
Series 2018-20, Class PT.	11.77%	11/16/2043	189	177,757	0.0
Series 2019-36, Class PT.	13.12%	10/17/2044	1,571	1,530,858	0.0
Consumer Loan Underlying Bond Club Certificate Issuer Trust I					
Series 2018-4, Class PT.	6.57%	05/15/2043	30	28,201	0.0
Series 2018-12, Class PT.	9.36%	06/15/2043	79	74,908	0.0
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust,					
Series 2018-3, Class PT.	3.15%	03/16/2043	21	18,888	0.0
				<u>2,603,140</u>	<u>0.0</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Digicel Group Holdings Ltd.(a) (d)	7.00%	03/15/2023	USD 1,391	\$ 111,246	0.0%
INVESTITIONSGÜTER					
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	20,393	61,179	0.0
				172,425	0.0
				502,979,755	3.5
Gesamtanlagen				\$ 13,879,465,332	99.2%
(Kosten \$16,209,549,785)					
Termineinlagen					
ANZ, London(l)	2.09 %	–		980,357	0.0
BBH, Grand Cayman(l)	4.10 %	–		36,470	0.0
BNP Paribas, Paris(l)	0.74 %	–		52,460	0.0
HSBC, Paris(l)	1.53 %	–		4,641,100	0.0
HSBC, Singapore(l)	2.56 %	–		103,084	0.0
Scotiabank, Toronto(l)	3.33 %	–		294,948	0.0
Scotiabank, Toronto(l)	3.93 %	–		5,475,924	0.0
SMBC, London(l)	2.92 %	–		8,316,324	0.1
SMBC, London(l)	3.93 %	–		103,747,093	0.7
SMBC, Tokyo(l)	3.93 %	–		48,680,733	0.4
Standard Chartered Bank, Johannesburg(l)	5.62 %	–		4,487,386	0.0
Termineinlagen insgesamt				176,815,879	1.2
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				(59,396,039)	(0.4)
Nettovermögen				\$ 13,996,885,172	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Long					
U.S. Long Bond (CBT) Futures	06/21/2023	2,298	\$ 290,201,211	\$ 287,752,688	\$ (2,448,523)
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	06/30/2023	3,595	733,291,382	732,396,990	(894,392)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	06/30/2023	2,562	275,041,313	274,274,111	(767,202)
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	03/22/2023	164	22,077,938	22,068,250	(9,688)
Short					
U.S. 10 Yr Ultra Future	06/21/2023	2,078	243,380,563	243,515,625	(135,062)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	06/21/2023	2,060	230,117,273	230,011,875	105,398
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	06/21/2023	822	111,112,125	111,021,375	90,750
					\$ (4,058,719)
				Wertsteigerung	\$ 196,148
				Wertminderung	\$ (4,254,867)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Bank of America, NA.	COP 159,104,554	USD 33,023	03/17/2023	\$ 385,180
Bank of America, NA.	GBP 50,464	USD 61,550	03/24/2023	823,932
Bank of America, NA.	CAD 19,000	USD 14,201	03/30/2023	272,767
Bank of America, NA.	EUR 386,563	USD 411,874	05/11/2023	1,308,070
Bank of America, NA.	USD 10,752	EUR 10,097	05/11/2023	(28,652)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 1,944,804	USD 1,309,149	03/02/2023	489,380
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 83,668	USD 61,494	03/02/2023	175,510
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF 9,206	USD 9,811	03/02/2023	35,836
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 136,632	USD 144,304	03/02/2023	(211,522)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 79,184	USD 94,598	03/02/2023	(651,205)
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 119,053	USD 73,392	03/02/2023	(217,932)
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 37,081	USD 8,277	03/02/2023	(58,869)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 204,305	USD 151,329	03/02/2023	(180,848)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,336,159	AUD 1,944,804	03/02/2023	(27,497,030)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 62,339	CAD 83,668	03/02/2023	(1,021,432)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 9,942	CHF 9,206	03/02/2023	(166,053)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 145,985	EUR 136,632	03/02/2023	(1,467,088)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 95,450	GBP 79,184	03/02/2023	(203,222)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 74,241	NZD 119,053	03/02/2023	(630,736)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 8,322	PLN 37,081	03/02/2023	13,240
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 153,731	SGD 204,305	03/02/2023	(2,220,293)

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 800,674	ZAR 14,330,103	03/02/2023	\$ (20,378,685)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 14,330,103	USD 776,735	03/02/2023	(3,558,935)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 741,739	USD 511,418	03/08/2023	12,189,618
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 43,792	USD 32,584	03/08/2023	488,084
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 7,596	USD 1,107	03/08/2023	13,581
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 42,244	USD 50,931	03/08/2023	111,956
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 109,769	USD 82,851	03/08/2023	1,436,540
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 984,663	AUD 1,444,982	03/08/2023	(12,120,238)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 63,660	CAD 86,074	03/08/2023	(575,174)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 29,670	CNH 200,827	03/08/2023	(771,345)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 98,039	GBP 81,679	03/08/2023	221,132
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 160,560	SGD 214,690	03/08/2023	(1,324,123)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 788,172	ZAR 14,218,109	03/08/2023	(14,383,366)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 7,333,693	USD 414,819	03/08/2023	15,698,700
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 582,797	USD 401,983	03/17/2023	9,593,622
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 42,394	USD 31,627	03/17/2023	553,219
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 5,039	USD 732	03/17/2023	6,993
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 64,547	USD 69,162	03/17/2023	822,536
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 41,743	USD 50,315	03/17/2023	87,984
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 39,204	USD 8,798	03/17/2023	(6,110)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 102,461	USD 76,810	03/17/2023	797,879
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 776,976	AUD 1,139,851	03/17/2023	(9,528,478)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 62,218	CAD 84,018	03/17/2023	(637,827)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 30,697	CNH 210,054	03/17/2023	(451,306)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 131,040	EUR 123,161	03/17/2023	(649,665)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 97,805	GBP 81,494	03/17/2023	248,100
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 17,079	PLN 76,310	03/17/2023	56,054
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 150,231	SGD 201,574	03/17/2023	(688,897)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 464,624	ZAR 8,467,282	03/17/2023	(4,191,635)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 4,380,724	USD 243,171	03/17/2023	4,955,490
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 703,473	USD 479,811	03/24/2023	6,038,172
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF 9,408	USD 10,160	03/24/2023	144,302
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 80,083	USD 85,342	03/24/2023	517,539
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 126,391	USD 78,817	03/24/2023	667,579
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 940,475	AUD 1,387,616	03/24/2023	(5,947,620)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 19,971	CHF 18,615	03/24/2023	(155,093)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 164,661	EUR 155,180	03/24/2023	(296,599)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 152,209	NZD 245,444	03/24/2023	(447,871)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 373,524	ZAR 6,858,868	03/24/2023	(792,172)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 3,499,738	USD 191,594	03/24/2023	1,408,668
Citibank, NA	INR 1,111,024	USD 13,364	03/16/2023	(69,329)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 35,425	EUR 33,133	05/11/2023	(233,864)
Royal Bank of Scotland PLC	EUR 386,563	USD 411,081	04/13/2023	1,159,584
UBS AG	USD 9,741	EUR 9,167	05/11/2023	(4,967)
				\$ (51,046,934)
			Wertsteigerung	\$ 60,721,247
			Wertminderung	\$ (111,768,181)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Verkaufskontrakte					
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 39, 5 Year Index	12/20/2027	USD 1,024,840	\$ 15,002,377	\$ 51,129,443
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	iTraxx-XOVER Series 38, 5 Year Index	12/20/2027	EUR 634,100	22,253,387	46,971,009
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	Ford Motor Company	06/20/2023	USD 6,370	77,188	134,733
Insgesamt				\$ 37,332,952	\$ 98,235,185

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Verkaufskontrakte						
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 15,404	\$ (6,101,585)	\$ (7,207,361)	\$ 1,105,776
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 19,169	(7,592,723)	(8,262,375)	669,652
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 8,169	(3,235,799)	(3,883,260)	647,461
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 1,706	(675,702)	(208,917)	(466,785)

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,412	\$ (1,351,403)	\$ (495,952)	\$ (855,451)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,412	(1,351,403)	(49,879)	(1,301,524)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 6,824	(2,702,806)	(922,110)	(1,780,696)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 6,824	(2,702,806)	55,351	(2,758,157)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 12,716	(5,036,679)	(1,922,484)	(3,114,195)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 17,059	(6,757,015)	(3,577,710)	(3,179,305)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 689	(134,168)	(71,865)	(62,303)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 947	(184,481)	(121,567)	(62,914)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,870	(559,033)	(343,819)	(215,214)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,166	(811,604)	(422,391)	(389,213)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,066	(408,504)	(208,196)	(194,308)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 11,228	(2,187,161)	(1,071,836)	(1,115,325)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 68,416	(13,327,351)	(6,103,207)	(7,224,144)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,722	(335,420)	(163,775)	(171,645)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,722	(335,420)	(623,685)	(172,735)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,367	(461,091)	(237,084)	(224,007)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 3,482	(678,219)	(368,309)	(309,910)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(642,513)	(475,553)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,081	(1,220,317)	(1,439,583)	219,266
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,081	(1,220,317)	(1,439,583)	219,266
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 10,127	(4,011,317)	(1,844,916)	(2,166,401)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 34,614	(13,710,795)	(6,628,116)	(7,082,679)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,548	(496,310)	(623,648)	127,338
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,096	(992,619)	(1,074,128)	81,509
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,096	(992,619)	(1,074,128)	81,509
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,548	(496,310)	(519,836)	23,526
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 18	(3,578)	(2,358)	(1,220)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,219	(237,365)	(118,695)	(118,670)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,870	(559,033)	(268,368)	(290,665)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,873	(949,350)	(471,310)	(478,040)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 8,609	(1,677,099)	(1,118,889)	(558,210)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 14,349	(2,795,166)	(1,840,927)	(954,239)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 9,957	(1,939,621)	(969,396)	(970,225)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 50,365	(9,811,144)	(7,052,644)	(2,758,500)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,412	(1,351,403)	(461,055)	(890,348)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 6,824	(2,702,806)	(922,110)	(1,780,696)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,870	(559,033)	(367,941)	(191,092)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,791	(543,604)	(265,243)	(278,361)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,870	(559,033)	(280,639)	(278,394)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(795,379)	(322,687)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(744,096)	(373,970)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 8,609	(1,677,099)	(1,195,731)	(481,368)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(558,062)	(560,004)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 8,609	(1,677,099)	(1,103,824)	(573,275)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 11,479	(2,236,133)	(1,510,330)	(725,803)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 14,349	(2,795,166)	(1,988,447)	(806,719)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 28,698	(5,590,332)	(3,764,276)	(1,826,056)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 6,162	(2,440,634)	(2,817,882)	377,248
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 4,772	(1,890,343)	(2,059,781)	169,438
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 4,772	(1,890,343)	(1,903,422)	13,079
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 4,772	(1,890,343)	(1,892,291)	1,948
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 4,772	(1,890,072)	(1,880,891)	(9,181)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 4,772	(1,890,072)	(1,869,761)	(20,311)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 5,446	(2,157,110)	(1,904,084)	(253,026)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 5,446	(2,157,110)	(1,891,510)	(265,600)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,412	(1,351,403)	(301,729)	(1,049,674)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 12,739	(2,481,549)	(3,175,790)	694,241
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 12,739	(2,481,548)	(2,945,005)	463,457
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 746	(145,349)	(90,549)	(54,800)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(738,058)	(380,009)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 6,630	(1,291,590)	(622,335)	(669,255)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 14,349	(2,795,166)	(1,789,140)	(1,006,026)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 10,911	(2,125,444)	(1,034,195)	(1,091,249)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 11,689	(2,276,942)	(1,153,729)	(1,123,213)
Insgesamt				<u>\$ (154,474,389)</u>	<u>\$ (104,905,754)</u>	<u>\$ (49,568,635)</u>
					Wertsteigerung	\$ 4,894,714
					Wertminderung	\$ (54,463,349)
Swaps insgesamt						<u>\$ 48,666,550</u>

-
- (a) Zahlungen in Sachwerten (PIK)
 - (b) Wandelbares Wertpapier.
 - (c) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 28. Februar 2023.
 - (d) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
 - (e) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 28. Februar 2023.
 - (f) Not leidend.
 - (g) Not leidendes fälliges Wertpapier.
 - (h) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für offene OTC-Derivate zu dienen.
 - (i) Kredit, bei dem bis zur Endfälligkeit nur Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
 - (j) Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
 - (k) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
 - (l) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD	– Australian Dollar
CAD	– Canadian Dollar
CHF	– Swiss Franc
CNH	– Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
COP	– Colombian Peso
EUR	– Euro
GBP	– Great British Pound
INR	– Indian Rupee
NZD	– New Zealand Dollar
PLN	– Polish Zloty
SGD	– Singapore Dollar
USD	– United States Dollar
ZAR	– South African Rand

Glossar:

ABS	– Asset-Backed Securities
CBT	– Chicago Board of Trade
CDX-CMBX.NA	– North American Commercial Mortgage-Backed Index
CDX-NAHY	– North American High Yield Credit Default Swap Index
CLO	– Collateralized Loan Obligations
CMBS	– Commercial Mortgage-Backed Securities
INTRCONX	– Inter-Continental Exchange
REIT	– Real Estate Investment Trust
REMICs	– Real Estate Mortgage Investment Conduits

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
ABN AMRO Bank NV	4.80%	04/18/2026	USD 7,000	\$ 6,728,468	0.0%
AIB Group PLC	4.26%	04/10/2025	60,316	58,939,483	0.3
AIB Group PLC	7.58%	10/14/2026	46,209	47,381,895	0.3
Ally Financial, Inc.	6.70%	02/14/2033	15,076	14,282,689	0.1
Ally Financial, Inc.	7.10%	11/15/2027	19,842	20,615,537	0.1
Ally Financial, Inc.	8.00%	11/01/2031	29,727	32,161,245	0.2
AmSouth Bancorp	6.75%	11/01/2025	11,929	12,149,594	0.1
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	4.40%	05/19/2026	8,780	8,419,867	0.0
Australia & New Zealand Banking Group Ltd./ United Kingdom(a)	6.75%	06/15/2026	43,923	43,378,780	0.2
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series 9(a)	6.50%	03/05/2025	48,200	46,031,000	0.2
Banco Santander SA	4.18%	03/24/2028	13,200	12,321,949	0.1
Banco Santander SA	5.18%	11/19/2025	74,800	73,733,089	0.4
Bank of America Corp.	6.20%	11/10/2028	21,981	22,597,019	0.1
Bank of America Corp., Series B	8.05%	06/15/2027	34,006	36,218,756	0.2
Bank of America Corp., Series X(a)	6.25%	09/05/2024	5,657	5,638,549	0.0
Bank of Ireland Group PLC	6.25%	09/16/2026	11,177	11,202,693	0.1
Barclays PLC	7.39%	11/02/2028	37,126	39,004,735	0.2
Barclays PLC(a)	8.00%	03/15/2029	26,640	25,997,489	0.1
BNP Paribas SA	4.63%	03/13/2027	13,920	13,357,232	0.1
BNP Paribas SA(a)	7.75%	08/16/2029	18,753	19,088,611	0.1
BPCE SA	4.50%	03/15/2025	13,000	12,552,359	0.1
BPCE SA	4.63%	07/11/2024	21,672	21,182,273	0.1
BPCE SA	5.15%	07/21/2024	23,413	23,032,937	0.1
BPCE SA	5.98%	01/18/2027	30,162	30,124,288	0.2
Capital One Financial Corp.	4.93%	05/10/2028	19,600	18,960,017	0.1
Capital One Financial Corp.	5.47%	02/01/2029	16,262	15,955,378	0.1
Capital One Financial Corp.	5.82%	02/01/2034	9,700	9,419,200	0.1
Citigroup, Inc.(a)	3.88%	02/18/2026	24,915	22,351,480	0.1
Citigroup, Inc.(a) (b)	8.87%	04/30/2023	6,148	6,181,516	0.0
Citigroup, Inc., Series P(a)	5.95%	05/15/2025	10,465	10,201,290	0.1
Citigroup, Inc., Series U(a)	5.00%	09/12/2024	26,500	25,205,373	0.1
Citigroup, Inc., Series V(a)	4.70%	01/30/2025	9,977	9,120,641	0.0
Citigroup, Inc., Series W(a)	4.00%	12/10/2025	16,145	14,742,387	0.1
Commerzbank AG	8.13%	09/19/2023	12,284	12,339,389	0.1
Credit Agricole SA(a)	8.13%	12/23/2025	21,494	21,711,519	0.1
Credit Agricole SA	8.13%	03/23/2171	19,693	19,934,635	0.1
Credit Suisse Group AG(a)	7.50%	12/11/2023	2,004	1,848,690	0.0
Danske Bank A/S	4.30%	04/01/2028	34,018	32,106,921	0.2
Danske Bank A/S	6.47%	01/09/2026	45,279	45,609,100	0.2
Deutsche Bank AG/New York NY	3.96%	11/26/2025	11,625	11,157,457	0.1
Deutsche Bank AG/New York NY	6.12%	07/14/2026	24,309	24,287,978	0.1
Deutsche Bank AG/New York NY	6.72%	01/18/2029	17,431	17,599,780	0.1
Deutsche Bank AG/New York NY	7.08%	02/10/2034	15,946	15,465,813	0.1
Discover Bank	4.68%	08/09/2028	42,248	40,798,018	0.2
Discover Financial Services	6.70%	11/29/2032	8,741	9,031,863	0.0
Dresdner Funding Trust I	8.15%	06/30/2031	11,620	12,497,875	0.1
First-Citizens Bank & Trust Co.	2.97%	09/27/2025	2,736	2,598,972	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(a) (c)	7.73%	03/31/2023	5,804	5,743,775	0.0
HSBC Holdings PLC	4.76%	03/29/2033	17,054	15,265,402	0.1
HSBC Holdings PLC(a)	6.38%	03/30/2025	9,850	9,644,346	0.1
HSBC Holdings PLC(a)	6.50%	03/23/2028	17,335	16,213,629	0.1
HSBC Holdings PLC	7.34%	11/03/2026	38,000	39,547,480	0.2
HSBC Holdings PLC	8.11%	11/03/2033	15,000	16,473,363	0.1
ING Groep NV(a)	6.75%	04/16/2024	31,733	31,108,458	0.2
Intesa Sanpaolo SpA	5.02%	06/26/2024	29,505	28,449,215	0.2
Intesa Sanpaolo SpA	5.71%	01/15/2026	3,000	2,882,287	0.0
Intesa Sanpaolo SpA	7.00%	11/21/2025	7,544	7,709,048	0.0
JPMorgan Chase & Co.	4.32%	04/26/2028	43,463	41,531,469	0.2
JPMorgan Chase & Co.	4.57%	06/14/2030	17,051	16,188,517	0.1
KBC Group NV	5.80%	01/19/2029	6,983	6,914,287	0.0
Lloyds Banking Group PLC	0.00%	03/06/2029	16,838	16,835,582	0.1
Lloyds Banking Group PLC	4.58%	12/10/2025	22,665	21,784,940	0.1
Lloyds Banking Group PLC(a)	7.50%	06/27/2024	25,585	25,211,884	0.1
Lloyds Banking Group PLC	7.95%	11/15/2033	11,000	12,010,991	0.1
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	5.02%	07/20/2028	19,113	18,725,938	0.1
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	5.48%	02/22/2031	5,467	5,418,520	0.0
Mizuho Financial Group Cayman 3 Ltd.	4.60%	03/27/2024	17,908	17,647,334	0.1
Mizuho Financial Group, Inc.	5.41%	09/13/2028	32,219	32,058,366	0.2
Mizuho Financial Group, Inc.	5.67%	05/27/2029	19,544	19,488,508	0.1
Mizuho Financial Group, Inc.	5.74%	05/27/2031	19,544	19,518,243	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Morgan Stanley	4.21%	04/20/2028	USD 17,502	\$ 16,638,246	0.1%
Morgan Stanley	5.12%	02/01/2029	3,046	2,992,487	0.0
Morgan Stanley	6.30%	10/18/2028	58,487	60,153,868	0.3
NatWest Group PLC	7.47%	11/10/2026	13,274	13,798,294	0.1
Nordea Bank Abp(a)	6.63%	03/26/2026	59,046	57,212,637	0.3
PNC Bank NA	5.90%	04/01/2026	7,500	7,488,587	0.0
Santander Holdings USA, Inc.	2.49%	01/06/2028	11,140	9,711,557	0.1
Santander Holdings USA, Inc.	4.40%	07/13/2027	42,389	40,255,052	0.2
Santander Holdings USA, Inc.	5.81%	09/09/2026	7,436	7,441,834	0.0
Santander UK Group Holdings PLC	6.83%	11/21/2026	57,306	58,283,247	0.3
Skandinaviska Enskilda Banken AB(a)	6.88%	06/30/2027	600	588,491	0.0
Societe Generale SA	4.25%	04/14/2025	11,148	10,691,806	0.1
Societe Generale SA	4.25%	08/19/2026	17,260	16,299,787	0.1
Societe Generale SA	4.75%	11/24/2025	22,112	21,381,783	0.1
Societe Generale SA	6.45%	01/12/2027	6,504	6,559,318	0.0
Standard Chartered PLC	2.82%	01/30/2026	17,000	16,029,966	0.1
Standard Chartered PLC	6.17%	01/09/2027	17,951	18,133,414	0.1
Standard Chartered PLC(a) (c)	6.31%	01/30/2027	34,013	30,245,248	0.2
Standard Chartered PLC(a)	7.75%	04/02/2023	2,493	2,494,163	0.0
Standard Chartered PLC	7.75%	02/15/2172	881	885,790	0.0
Standard Chartered PLC	7.78%	11/16/2025	18,560	19,178,000	0.1
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	5.71%	01/13/2030	47,514	47,815,419	0.3
Svenska Handelsbanken AB(a)	4.38%	03/01/2027	1,800	1,614,091	0.0
Svenska Handelsbanken AB(a)	4.75%	03/01/2031	13,600	11,633,926	0.1
Swedbank AB, Series NC5(a)	5.63%	09/17/2024	13,600	13,042,460	0.1
Synchrony Bank	5.63%	08/23/2027	13,761	13,474,686	0.1
UBS AG	5.13%	05/15/2024	7,742	7,664,146	0.0
UBS Group AG	4.49%	05/12/2026	4,473	4,365,682	0.0
UBS Group AG(a)	7.00%	01/31/2024	12,992	12,979,827	0.1
UBS Group AG(a)	7.00%	02/19/2025	28,847	28,712,339	0.2
UniCredit SpA	4.63%	04/12/2027	1,425	1,359,959	0.0
UniCredit SpA	7.83%	12/04/2023	67,650	68,577,816	0.4
				<u>2,089,341,337</u>	<u>11.3</u>
MAKLER					
Charles Schwab Corp. (The), Series G(a)	5.38%	06/01/2025	19,303	19,148,098	0.1
Nomura Holdings, Inc.	5.71%	01/09/2026	41,652	41,590,808	0.2
				<u>60,738,906</u>	<u>0.3</u>
FINANZEN					
Aircastle Ltd.	2.85%	01/26/2028	8,142	6,918,659	0.0
Aircastle Ltd.	4.13%	05/01/2024	4,820	4,706,768	0.0
Aircastle Ltd.	4.25%	06/15/2026	1,132	1,072,686	0.0
Aircastle Ltd.	4.40%	09/25/2023	12,230	12,123,280	0.1
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	46,031	45,022,300	0.3
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	5,354	4,726,095	0.0
Aviation Capital Group LLC	1.95%	09/20/2026	13,175	11,342,454	0.1
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	8,286	7,272,720	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	117	109,795	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	4,985	4,755,405	0.0
Synchrony Financial	2.88%	10/28/2031	18	13,548	0.0
Synchrony Financial	3.95%	12/01/2027	24,323	22,172,328	0.1
Synchrony Financial	4.88%	06/13/2025	17,086	16,632,662	0.1
Synchrony Financial	5.15%	03/19/2029	264	248,054	0.0
				<u>137,116,754</u>	<u>0.7</u>
VERSICHERUNGEN					
ACE Capital Trust II	9.70%	04/01/2030	31,826	39,041,151	0.2
Allstate Corp. (The)	6.50%	05/15/2057	8,665	8,406,042	0.0
Allstate Corp. (The), Series B	5.75%	08/15/2053	35,856	35,283,096	0.2
Argentum Netherlands BV for Swiss Re Ltd.	5.63%	08/15/2052	21,351	20,555,534	0.1
Argentum Netherlands BV for Swiss Re Ltd.	5.75%	08/15/2050	18,619	18,016,545	0.1
Cloverie PLC for Zurich Insurance Co., Ltd.	5.63%	06/24/2046	3,300	3,239,673	0.0
Hartford Financial Services Group, Inc. (The), Series ICON(c)	6.99%	02/12/2047	61,341	53,206,044	0.3
Liberty Mutual Group, Inc.	7.80%	03/15/2037	6,501	7,122,801	0.0
MetLife Capital Trust IV	7.88%	12/15/2037	11,997	12,938,511	0.1
MetLife, Inc.	6.40%	12/15/2036	7,456	7,476,703	0.0
MetLife, Inc.	10.75%	08/01/2039	8,590	11,576,936	0.1
Nationwide Mutual Insurance Co.(c)	7.06%	12/15/2024	1,000	1,000,583	0.0
Prudential Financial, Inc.	5.20%	03/15/2044	42,601	41,854,248	0.2
Prudential Financial, Inc.	5.63%	06/15/2043	52,407	52,223,195	0.3
Swiss Re Finance Luxembourg SA	5.00%	04/02/2049	15,690	14,928,339	0.1
Voya Financial, Inc.	5.65%	05/15/2053	68,904	68,667,606	0.4
				<u>395,537,007</u>	<u>2.1</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
REITs					
Boston Properties LP	6.75%	12/01/2027	USD 19,653	\$ 20,402,716	0.1%
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.25%	06/01/2025	14,960	14,670,505	0.1
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.38%	04/15/2026	5,190	5,063,940	0.0
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	4.63%	08/01/2029	9,147	6,840,013	0.1
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.00%	10/15/2027	13,581	11,211,791	0.1
Office Properties Income Trust	3.45%	10/15/2031	9,432	6,287,456	0.0
Omega Healthcare Investors, Inc.	4.50%	01/15/2025	3,865	3,766,758	0.0
SITE Centers Corp.	4.70%	06/01/2027	18,600	17,439,483	0.1
Spirit Realty LP	4.00%	07/15/2029	14,882	13,122,326	0.1
STORE Capital Corp.	4.63%	03/15/2029	4,573	4,022,266	0.0
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	5.63%	05/01/2024	1,235	1,226,277	0.0
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	5.75%	02/01/2027	19,477	19,001,651	0.1
				<u>123,055,182</u>	<u>0.7</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Aviation Capital Group LLC	4.38%	01/30/2024	35,753	35,102,391	0.2
Aviation Capital Group LLC	5.50%	12/15/2024	30,672	30,288,479	0.2
				<u>65,390,870</u>	<u>0.4</u>
				<u>2,871,180,056</u>	<u>15.5</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Arconic Corp.	6.00%	05/15/2025	29,005	29,014,543	0.2
Celanese US Holdings LLC	5.90%	07/05/2024	8,615	8,604,429	0.1
Celanese US Holdings LLC	6.05%	03/15/2025	16,115	16,055,666	0.1
CF Industries, Inc.	4.95%	06/01/2043	5,949	4,979,913	0.0
CF Industries, Inc.	5.15%	03/15/2034	367	341,349	0.0
CF Industries, Inc.	5.38%	03/15/2044	14,821	13,080,363	0.1
Freeport-McMoRan, Inc.	5.40%	11/14/2034	9,609	9,079,910	0.1
Glencore Funding LLC	4.88%	03/12/2029	8,414	8,129,469	0.0
Huntsman International LLC	4.50%	05/01/2029	13,936	12,703,384	0.1
MEGlobal Canada ULC	5.00%	05/18/2025	5,875	5,749,422	0.0
MEGlobal Canada ULC	5.88%	05/18/2030	3,112	3,175,018	0.0
Olin Corp.	5.63%	08/01/2029	26,838	25,549,291	0.1
Rohm & Haas Co.	7.85%	07/15/2029	19,000	21,073,696	0.1
				<u>157,536,453</u>	<u>0.9</u>
INVESTITIONSGÜTER					
General Electric Co., Series D(a) (c)	8.10%	06/15/2023	41,196	41,142,877	0.2
Parker-Hannifin Corp.	4.50%	09/15/2029	31,682	30,267,822	0.2
Regal Rexnord Corp.	6.30%	02/15/2030	7,050	6,908,476	0.0
Regal Rexnord Corp.	6.40%	04/15/2033	8,346	8,177,347	0.0
Trane Technologies Financing Ltd.	5.25%	03/03/2033	12,407	12,306,533	0.1
				<u>98,803,055</u>	<u>0.5</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Directv Financing LLC/Directv Financing Co-Obligor, Inc.	5.88%	08/15/2027	28,188	25,286,845	0.1
Discovery Communications LLC	4.13%	05/15/2029	11,316	10,136,789	0.1
Paramount Global	4.95%	01/15/2031	20,000	17,894,593	0.1
Time Warner Entertainment Co. LP	8.38%	07/15/2033	15,020	16,861,116	0.1
Warnermedia Holdings, Inc.	4.05%	03/15/2029	1,895	1,693,536	0.0
Warnermedia Holdings, Inc.	4.28%	03/15/2032	19,532	16,866,928	0.1
				<u>88,739,807</u>	<u>0.5</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
AT&T, Inc.	7.13%	12/15/2031	3,042	3,297,662	0.0
British Telecommunications PLC	5.13%	12/04/2028	10,440	10,238,332	0.1
British Telecommunications PLC	9.63%	12/15/2030	39,776	48,001,230	0.3
Level 3 Financing, Inc.	3.88%	11/15/2029	44,770	33,945,184	0.2
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC	4.74%	03/20/2025	8,013	7,915,021	0.0
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC	5.15%	03/20/2028	9,140	9,028,506	0.0
				<u>112,425,935</u>	<u>0.6</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
General Motors Co.	6.13%	10/01/2025	14	14,153	0.0
General Motors Co.	6.25%	10/02/2043	7,450	7,011,480	0.1
General Motors Co.	6.80%	10/01/2027	15	15,651	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	4.00%	10/06/2026	62	58,792	0.0
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.05%	02/14/2027	27,594	24,749,457	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.35%	06/08/2025	10,525	10,041,397	0.1
Lear Corp.	3.50%	05/30/2030	7,020	6,003,433	0.0
Lear Corp.	4.25%	05/15/2029	2,000	1,829,981	0.0
Nissan Motor Acceptance Co. LLC	2.45%	09/15/2028	23,303	18,641,593	0.1
Nissan Motor Co., Ltd.	4.35%	09/17/2027	20,699	18,852,124	0.1
				<u>87,218,061</u>	<u>0.5</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Hasbro, Inc.	3.90%	11/19/2029	USD 16,713	\$ 14,735,465	0.1%
Mattel, Inc.	3.75%	04/01/2029	5,000	4,326,034	0.0
				<u>19,061,499</u>	<u>0.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Genting New York LLC/GENNY Capital, Inc.	3.30%	02/15/2026	17,897	15,726,425	0.1
International Game Technology PLC	5.25%	01/15/2029	3,337	3,094,239	0.0
International Game Technology PLC	6.25%	01/15/2027	35,757	35,019,053	0.2
MDC Holdings, Inc.	2.50%	01/15/2031	7,000	5,170,877	0.0
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	3,723	3,135,629	0.0
Owens Corning	7.00%	12/01/2036	1,449	1,579,874	0.0
PulteGroup, Inc.	6.38%	05/15/2033	6,352	6,431,973	0.1
PulteGroup, Inc.	7.88%	06/15/2032	1,500	1,674,647	0.0
Resorts World Las Vegas LLC/RWLV Capital, Inc.	4.63%	04/16/2029	1,700	1,342,799	0.0
Resorts World Las Vegas LLC/RWLV Capital, Inc.	4.63%	04/06/2031	20,600	15,685,775	0.1
				<u>88,861,291</u>	<u>0.5</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
AutoNation, Inc.	3.85%	03/01/2032	10,000	8,384,084	0.1
Macy's Retail Holdings LLC	5.88%	04/01/2029	8,500	7,727,152	0.0
Macy's Retail Holdings LLC	5.88%	03/15/2030	4,040	3,560,527	0.0
Ross Stores, Inc.	4.70%	04/15/2027	14,291	13,996,302	0.1
				<u>33,668,065</u>	<u>0.2</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Altria Group, Inc.	4.80%	02/14/2029	38,826	37,247,317	0.2
BAT Capital Corp.	4.91%	04/02/2030	1,500	1,385,516	0.0
BAT Capital Corp.	7.75%	10/19/2032	11,741	12,605,928	0.1
BAT International Finance PLC.	4.45%	03/16/2028	36,222	33,842,188	0.2
Newell Brands, Inc.	6.38%	09/15/2027	16,159	16,065,253	0.1
Newell Brands, Inc.	6.63%	09/15/2029	16,159	16,020,296	0.1
Philip Morris International, Inc.	5.63%	11/17/2029	13,881	14,068,922	0.1
Pilgrim's Pride Corp.	4.25%	04/15/2031	6,202	5,194,175	0.0
Smithfield Foods, Inc.	3.00%	10/15/2030	4,774	3,710,400	0.0
				<u>140,139,995</u>	<u>0.8</u>
ENERGIE					
Boardwalk Pipelines LP	4.45%	07/15/2027	6,893	6,567,215	0.0
Boardwalk Pipelines LP	4.80%	05/03/2029	19,313	18,305,446	0.1
Cenovus Energy, Inc.	6.75%	11/15/2039	191	199,459	0.0
Cheniere Energy Partners LP	4.50%	10/01/2029	4,266	3,867,319	0.0
Continental Resources, Inc./OK	5.75%	01/15/2031	12,633	11,961,794	0.1
Enbridge Energy Partners LP	7.38%	10/15/2045	6,505	7,364,307	0.0
Energy Transfer LP	4.40%	03/15/2027	71,587	68,364,417	0.4
Energy Transfer LP	4.95%	05/15/2028	6,435	6,200,767	0.0
Energy Transfer LP	5.50%	06/01/2027	23,075	22,930,676	0.1
Energy Transfer LP	8.25%	11/15/2029	11,355	12,724,163	0.1
Eni SpA	4.25%	05/09/2029	12,712	11,670,206	0.1
Eni SpA, Series X-R	4.75%	09/12/2028	1,500	1,466,025	0.0
EnLink Midstream LLC	5.63%	01/15/2028	17,787	17,045,970	0.1
EnLink Midstream Partners LP	5.05%	04/01/2045	12,996	9,980,872	0.1
EnLink Midstream Partners LP	5.45%	06/01/2047	10,303	8,153,612	0.0
EnLink Midstream Partners LP	5.60%	04/01/2044	1,916	1,572,892	0.0
EQT Corp.	5.70%	04/01/2028	8,138	8,011,162	0.0
Hess Corp.	7.30%	08/15/2031	45,274	49,133,168	0.2
Hess Corp.	7.88%	10/01/2029	16,239	17,864,739	0.1
Kinder Morgan Energy Partners LP	7.30%	08/15/2033	9,000	9,793,044	0.1
Marathon Oil Corp.	4.40%	07/15/2027	201	191,461	0.0
Marathon Oil Corp.	6.80%	03/15/2032	10,144	10,464,548	0.1
ONEOK, Inc.	4.35%	03/15/2029	21,411	19,898,934	0.1
ONEOK, Inc.	6.10%	11/15/2032	12,074	12,147,588	0.1
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026	9,649	9,250,442	0.1
Suncor Energy, Inc.	7.15%	02/01/2032	12,130	13,162,628	0.1
Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp.	6.50%	07/15/2027	15,917	16,092,479	0.1
Tennessee Gas Pipeline Co. LLC	7.00%	10/15/2028	19,360	20,522,258	0.1
Var Energi ASA	7.50%	01/15/2028	16,538	17,054,492	0.1
Var Energi ASA	8.00%	11/15/2032	22,203	23,199,330	0.1
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025	21,298	20,269,582	0.1
Western Midstream Operating LP	4.50%	03/01/2028	4,159	3,839,464	0.0
Western Midstream Operating LP	4.65%	07/01/2026	12,047	11,450,615	0.1
Western Midstream Operating LP	4.75%	08/15/2028	7,998	7,406,646	0.0
				<u>478,127,720</u>	<u>2.6</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
DIENSTLEISTUNGEN					
Expedia Group, Inc.	6.25%	05/01/2025	USD 32,879	\$ 33,132,591	0.2%
Global Payments, Inc.	5.30%	08/15/2029	21,238	20,440,312	0.1
				<u>53,572,903</u>	<u>0.3</u>
TECHNOLOGIE					
Broadcom, Inc.	4.00%	04/15/2029	3,991	3,613,656	0.0
Broadcom, Inc.	4.15%	04/15/2032	19,296	17,020,196	0.1
Broadcom, Inc.	4.93%	05/15/2037	10,043	8,732,314	0.1
Entegris Escrow Corp.	4.75%	04/15/2029	35,879	32,627,440	0.2
HP, Inc.	4.75%	01/15/2028	33,320	32,078,729	0.2
Leidos, Inc.	7.13%	07/01/2032	2,000	2,128,800	0.0
Micron Technology, Inc.	6.75%	11/01/2029	30,883	31,852,617	0.2
NXP BV/NXP Funding LLC	5.35%	03/01/2026	21,052	20,867,795	0.1
SK Hynix, Inc.	6.25%	01/17/2026	3,141	3,133,116	0.0
SK Hynix, Inc.	6.38%	01/17/2028	4,544	4,471,296	0.0
SK Hynix, Inc.	6.50%	01/17/2033	5,000	4,904,700	0.0
Western Digital Corp.	2.85%	02/01/2029	864	679,337	0.0
Western Digital Corp.	3.10%	02/01/2032	2,576	1,855,004	0.0
Western Digital Corp.	4.75%	02/15/2026	8,564	8,073,113	0.0
				<u>172,038,113</u>	<u>0.9</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.75%	10/20/2028	31,075	29,367,118	0.1
Mileage Plus Holdings LLC/Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd.	6.50%	06/20/2027	53,233	53,181,326	0.3
				<u>82,548,444</u>	<u>0.4</u>
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN					
BNSF Funding Trust I	6.61%	12/15/2055	5,597	5,443,749	0.0
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
AerCap Global Aviation Trust	6.50%	06/15/2045	24,752	23,899,324	0.1
				<u>1,642,084,414</u>	<u>8.9</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Enel Finance International NV	7.50%	10/14/2032	30,164	32,618,892	0.2
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	6.05%	03/01/2025	6,475	6,518,160	0.0
NRG Energy, Inc.	3.75%	06/15/2024	10,265	9,941,691	0.1
				<u>49,078,743</u>	<u>0.3</u>
				<u>4,562,343,213</u>	<u>24.7</u>
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Bonds	3.38%	08/15/2042	200,555	180,092,133	1.0
U.S. Treasury Bonds	6.13%	11/15/2027	344,064	371,159,472	2.0
U.S. Treasury Bonds(d)	6.13%	08/15/2029	537,115	597,036,336	3.2
U.S. Treasury Bonds	6.25%	05/15/2030	747,077	847,815,929	4.6
U.S. Treasury Bonds	6.75%	08/15/2026	13,643	14,621,352	0.1
U.S. Treasury Bonds(d)	7.63%	02/15/2025	217,311	228,278,110	1.2
U.S. Treasury Notes	2.63%	05/31/2027	72,073	67,433,114	0.4
U.S. Treasury Notes	3.13%	08/31/2027	901,516	860,243,325	4.6
U.S. Treasury Notes	3.88%	11/30/2027	38,199	37,644,021	0.2
U.S. Treasury Notes	3.88%	12/31/2027	235,044	231,555,152	1.2
U.S. Treasury Notes	4.13%	01/31/2025	109,300	107,882,510	0.6
U.S. Treasury Notes	4.13%	10/31/2027	196,283	195,239,849	1.1
U.S. Treasury Notes	4.13%	11/15/2032	307,002	311,655,187	1.7
U.S. Treasury Notes	4.50%	11/30/2024	89,108	88,453,112	0.5
				<u>4,139,109,602</u>	<u>22.4</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
ASP Unifrax Holdings, Inc.	5.25%	09/30/2028	21,002	16,297,667	0.1
Cleveland-Cliffs, Inc.	6.75%	03/15/2026	1,879	1,898,736	0.0
CVR Partners LP/CVR Nitrogen Finance Corp.	6.13%	06/15/2028	29,221	26,219,822	0.1
Element Solutions, Inc.	3.88%	09/01/2028	7,512	6,507,837	0.0
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	4.38%	04/01/2031	7,000	5,885,827	0.0
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	4.50%	09/15/2027	7,573	6,980,772	0.0
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	6.13%	04/15/2032	49,506	46,702,354	0.3
Graphic Packaging International LLC	4.75%	07/15/2027	4,299	4,036,797	0.0
Ingevity Corp.	3.88%	11/01/2028	2,000	1,715,056	0.0
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc./ Intelligent Packaging Ltd. Co-Issuer LLC	6.00%	09/15/2028	27,796	24,156,042	0.1
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC.	5.38%	11/01/2026	30,671	27,560,622	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Sealed Air Corp.	6.13%	02/01/2028	USD 8,825	\$ 8,690,306	0.1%
WR Grace Holdings LLC	4.88%	06/15/2027	15,091	13,872,201	0.1
				<u>190,524,039</u>	<u>1.0</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/ Ardagh Metal Packaging Finance PLC					
	6.00%	06/15/2027	3,559	3,434,435	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	4.13%	08/15/2026	4,000	3,654,542	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	5.25%	04/30/2025	5,709	5,502,049	0.0
Bombardier, Inc.	7.88%	04/15/2027	25,720	25,552,459	0.1
Chart Industries, Inc.	7.50%	01/01/2030	9,186	9,326,653	0.1
Clean Harbors, Inc.	5.13%	07/15/2029	4,501	4,209,297	0.0
Clean Harbors, Inc.	6.38%	02/01/2031	4,620	4,604,569	0.0
Eco Material Technologies, Inc.	7.88%	01/31/2027	19,423	18,621,565	0.1
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028	41,527	38,232,659	0.2
JELD-WEN, Inc.	4.63%	12/15/2025	7,955	7,149,567	0.1
LSB Industries, Inc.	6.25%	10/15/2028	4,104	3,735,537	0.0
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027	4,000	3,676,489	0.0
Stevens Holding Co., Inc.	6.13%	10/01/2026	4,933	5,009,921	0.0
TK Elevator US Newco, Inc.	5.25%	07/15/2027	21,995	20,051,725	0.1
Triumph Group, Inc.	8.88%	06/01/2024	8,637	9,025,489	0.1
WESCO Distribution, Inc.	7.13%	06/15/2025	10,456	10,564,201	0.1
WESCO Distribution, Inc.	7.25%	06/15/2028	9,211	9,358,974	0.1
				<u>181,710,131</u>	<u>1.0</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Advantage Sales & Marketing, Inc.					
	6.50%	11/15/2028	13,968	10,674,312	0.1
Altice Financing SA.	5.00%	01/15/2028	42,199	35,011,782	0.2
Altice Financing SA.	5.75%	08/15/2029	24,913	20,529,441	0.1
AMC Networks, Inc.	4.75%	08/01/2025	16,866	15,952,800	0.1
Banjijay Entertainment SASU	5.38%	03/01/2025	3,926	3,812,423	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	08/15/2030	10,354	8,537,992	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	06/01/2033	63,959	49,789,079	0.3
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.75%	02/01/2032	10,382	8,455,898	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	7.38%	03/01/2031	17,363	16,846,661	0.1
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027	35,171	31,393,349	0.2
CSC Holdings LLC	3.38%	02/15/2031	7,991	5,480,979	0.0
CSC Holdings LLC	5.00%	11/15/2031	23,052	12,289,372	0.1
CSC Holdings LLC	5.75%	01/15/2030	37,402	21,411,742	0.1
DISH DBS Corp.	5.13%	06/01/2029	7,462	4,410,734	0.0
DISH DBS Corp.	5.25%	12/01/2026	32,078	26,799,056	0.1
DISH DBS Corp.	5.75%	12/01/2028	28,439	22,714,356	0.1
DISH DBS Corp.	7.75%	07/01/2026	5,157	3,999,418	0.0
Gray Escrow II, Inc.	5.38%	11/15/2031	44,997	33,410,143	0.2
iHeartCommunications, Inc.	4.75%	01/15/2028	11,469	9,676,617	0.1
iHeartCommunications, Inc.	5.25%	08/15/2027	3,725	3,249,971	0.0
iHeartCommunications, Inc.	6.38%	05/01/2026	8,252	7,773,496	0.0
LCPR Senior Secured Financing DAC	5.13%	07/15/2029	32,037	27,009,336	0.2
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027	25,707	23,834,997	0.1
McGraw-Hill Education, Inc.	5.75%	08/01/2028	40,341	35,330,950	0.2
National CineMedia LLC	5.88%	04/15/2028	14,789	4,649,066	0.0
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030	19,585	14,408,571	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	3.88%	09/01/2031	10,359	8,056,424	0.0
Sirius XM Radio, Inc.	4.00%	07/15/2028	5,813	4,974,913	0.0
Sirius XM Radio, Inc.	5.00%	08/01/2027	19,575	17,964,158	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	5.50%	07/01/2029	30,696	27,670,239	0.2
Summer BC Bidco B LLC	5.50%	10/31/2026	700	601,731	0.0
Univision Communications, Inc.	4.50%	05/01/2029	11,302	9,533,134	0.1
Univision Communications, Inc.	6.63%	06/01/2027	27,939	26,627,632	0.1
Univision Communications, Inc.	7.38%	06/30/2030	16,494	15,649,783	0.1
Virgin Media Secured Finance PLC	4.50%	08/15/2030	946	783,418	0.0
Ziggo Bond Co. BV	5.13%	02/28/2030	794	634,746	0.0
Ziggo BV	4.88%	01/15/2030	24,189	20,487,043	0.1
				<u>590,435,762</u>	<u>3.2</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Connect Finco SARL/Connect US Finco LLC					
	6.75%	10/01/2026	40,042	37,138,955	0.2
Consolidated Communications, Inc.	5.00%	10/01/2028	5,895	3,932,478	0.0
Consolidated Communications, Inc.	6.50%	10/01/2028	36,075	26,001,312	0.1
Embarq Corp.	8.00%	06/01/2036	21,303	9,259,127	0.1
Iliad Holding SASU	6.50%	10/15/2026	14,216	13,347,848	0.1
Iliad Holding SASU	7.00%	10/15/2028	9,698	8,955,318	0.1
Telecom Italia Capital SA	7.20%	07/18/2036	9,850	8,685,529	0.0
Telecom Italia Capital SA	7.72%	06/04/2038	7,678	6,980,253	0.0
Vmed O2 UK Financing I PLC	4.75%	07/15/2031	6,675	5,515,268	0.0
				<u>119,816,088</u>	<u>0.6</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.50%	04/01/2027	USD 4,888	\$ 4,509,478	0.0%
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.88%	07/01/2028	10,159	9,115,583	0.1
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	6.25%	05/15/2026	20,680	20,297,811	0.1
Dana, Inc.	4.25%	09/01/2030	5,591	4,513,465	0.0
Dana, Inc.	5.38%	11/15/2027	12,089	11,157,131	0.1
Ford Motor Co.	6.10%	08/19/2032	78,228	73,113,473	0.4
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	5.00%	07/15/2029	2,698	2,347,676	0.0
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	5.25%	07/15/2031	2,860	2,432,027	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(e)	6.00%	05/15/2027	23,494	21,829,303	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(e)	6.38%	05/15/2029	12,577	11,354,989	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.50%	07/15/2029	22,261	17,865,487	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	01/15/2028	31,879	27,321,647	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	7.75%	10/15/2025	34,461	34,009,334	0.2
ZF North America Capital, Inc.	4.75%	04/29/2025	14,495	13,837,835	0.1
				253,705,239	1.4
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	4.00%	08/01/2028	13,272	11,220,680	0.1
Carnival Corp.	5.75%	03/01/2027	58,296	47,802,720	0.3
Carnival Corp.	9.88%	08/01/2027	12,000	12,150,000	0.1
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op.	5.50%	05/01/2025	52,796	52,207,318	0.3
NCL Corp., Ltd.	8.38%	02/01/2028	27,665	28,116,196	0.2
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.38%	07/15/2027	18,007	15,801,142	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	08/31/2026	23,060	21,140,486	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	04/01/2028	15,887	13,811,761	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	7.25%	01/15/2030	6,586	6,602,465	0.0
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	5.25%	08/15/2029	19,109	17,054,532	0.1
Vail Resorts, Inc.	6.25%	05/15/2025	8,044	8,044,000	0.0
Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd.	5.63%	02/15/2029	8,267	7,099,864	0.0
VOC Escrow Ltd.	5.00%	02/15/2028	52,267	46,029,328	0.2
				287,080,492	1.6
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Adams Homes, Inc.	7.50%	02/15/2025	10,468	9,181,025	0.1
Beazer Homes USA, Inc.	6.75%	03/15/2025	500	496,639	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	4.88%	02/15/2030	28,915	21,770,189	0.1
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	6.25%	09/15/2027	49,014	43,039,674	0.2
Builders FirstSource, Inc.	6.38%	06/15/2032	5,000	4,806,527	0.0
Caesars Entertainment, Inc.	6.25%	07/01/2025	29,496	29,271,319	0.2
Caesars Entertainment, Inc.	7.00%	02/15/2030	8,522	8,582,513	0.1
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/	4.88%	07/01/2031	2,742	2,305,310	0.0
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/	5.00%	06/01/2029	29,655	26,089,060	0.1
Installed Building Products, Inc.	5.75%	02/01/2028	5,196	4,827,476	0.0
KB Home	4.80%	11/15/2029	2,965	2,603,799	0.0
KB Home	6.88%	06/15/2027	4,102	4,101,336	0.0
Mattamy Group Corp.	4.63%	03/01/2030	17,799	14,746,923	0.1
MGM Resorts International	4.75%	10/15/2028	1,606	1,439,298	0.0
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	02/15/2028	19,163	17,037,963	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.75%	01/15/2028	8,959	8,456,227	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.88%	06/15/2027	15,629	14,970,102	0.1
Travel + Leisure Co.	4.50%	12/01/2029	29,347	24,718,818	0.1
Travel + Leisure Co.	4.63%	03/01/2030	3,108	2,614,228	0.0
Travel + Leisure Co.	6.63%	07/31/2026	24,160	23,737,700	0.1
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.25%	05/15/2027	11,291	10,527,104	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	5.13%	10/01/2029	13,465	12,036,363	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	7.13%	02/15/2031	6,200	6,176,962	0.0
				293,536,555	1.6
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Arko Corp.	5.13%	11/15/2029	11,996	9,493,180	0.1
Asbury Automotive Group, Inc.	5.00%	02/15/2032	16,593	14,215,465	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.63%	10/01/2030	16,754	15,880,150	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.75%	07/01/2036	29,820	25,773,015	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.88%	11/01/2035	23,725	20,898,137	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.95%	03/01/2033	329	286,757	0.0
Bath & Body Works, Inc.	7.50%	06/15/2029	7,154	7,175,316	0.0
Bath & Body Works, Inc.	7.60%	07/15/2037	716	606,994	0.0
FirstCash, Inc.	4.63%	09/01/2028	7,381	6,416,256	0.0
FirstCash, Inc.	5.63%	01/01/2030	21,733	19,297,049	0.1
Michaels Cos, Inc. (The)	5.25%	05/01/2028	23,129	19,227,248	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Murphy Oil USA, Inc.	4.75%	09/15/2029	USD 11,452	\$ 10,232,527	0.1%
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.	4.75%	02/15/2028	28,180	25,794,169	0.1
Sonic Automotive, Inc.	4.63%	11/15/2029	21,778	17,971,929	0.1
Sonic Automotive, Inc.	4.88%	11/15/2031	2,453	1,953,106	0.0
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp.	6.38%	09/30/2026	10,386	9,531,578	0.1
Staples, Inc.	7.50%	04/15/2026	31,586	28,099,727	0.2
Wolverine World Wide, Inc.	4.00%	08/15/2029	7,890	6,360,174	0.0
				<u>239,212,777</u>	<u>1.3</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
AdaptHealth LLC	6.13%	08/01/2028	6,613	6,101,118	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	4.88%	02/15/2030	15,673	14,112,796	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	6.50%	02/15/2028	19,604	19,491,427	0.1
CD&R Smokey Buyer, Inc.	6.75%	07/15/2025	1,977	1,724,299	0.0
Darling Ingredients, Inc.	6.00%	06/15/2030	9,928	9,597,686	0.1
DaVita, Inc.	3.75%	02/15/2031	27,188	20,588,895	0.1
DaVita, Inc.	4.63%	06/01/2030	26,831	22,104,824	0.1
Elanco Animal Health, Inc.	6.65%	08/28/2028	15,301	14,610,317	0.1
Embecta Corp.	5.00%	02/15/2030	17,080	14,483,268	0.1
Emergent BioSolutions, Inc.	3.88%	08/15/2028	1,537	909,889	0.0
Garden Spinco Corp.	8.63%	07/20/2030	10,941	11,561,614	0.1
Grifols Escrow Issuer SA	4.75%	10/15/2028	7,443	6,365,086	0.0
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc.	5.00%	12/31/2026	33,210	30,149,518	0.2
Legacy LifePoint Health LLC	6.75%	04/15/2025	64,710	61,698,159	0.3
Medline Borrower LP	3.88%	04/01/2029	60,452	50,409,877	0.3
ModivCare Escrow Issuer, Inc.	5.00%	10/01/2029	2,163	1,847,081	0.0
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV	4.13%	04/30/2028	10,771	9,503,288	0.1
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV	5.13%	04/30/2031	20,955	17,860,120	0.1
Perrigo Finance Unlimited Co.	4.40%	06/15/2030	2,000	1,706,783	0.0
Post Holdings, Inc.	5.50%	12/15/2029	6,547	6,005,738	0.0
Post Holdings, Inc.	5.63%	01/15/2028	7,135	6,846,444	0.0
Primo Water Holdings, Inc.	4.38%	04/30/2029	2,000	1,715,734	0.0
RP Escrow Issuer LLC	5.25%	12/15/2025	24,848	19,409,280	0.1
Spectrum Brands, Inc.	3.88%	03/15/2031	2,000	1,582,325	0.0
US Acute Care Solutions LLC	6.38%	03/01/2026	9,491	8,412,526	0.0
				<u>358,798,092</u>	<u>1.9</u>
ENERGIE					
Berry Petroleum Co. LLC	7.00%	02/15/2026	3,175	2,993,491	0.0
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	7.63%	12/15/2025	11,064	11,129,569	0.1
CITGO Petroleum Corp.	6.38%	06/15/2026	13,237	12,875,811	0.1
CITGO Petroleum Corp.	7.00%	06/15/2025	45,862	45,135,402	0.3
Civitas Resources, Inc.	5.00%	10/15/2026	4,730	4,379,994	0.0
CNX Resources Corp.	6.00%	01/15/2029	13,971	12,664,200	0.1
Comstock Resources, Inc.	5.88%	01/15/2030	2,995	2,575,711	0.0
CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC	5.50%	06/15/2031	16,660	14,607,270	0.1
Crescent Energy Finance LLC	7.25%	05/01/2026	15,590	14,531,132	0.1
Encino Acquisition Partners Holdings LLC	8.50%	05/01/2028	12,292	10,813,560	0.1
EQM Midstream Partners LP	4.50%	01/15/2029	18,035	15,081,473	0.1
EQM Midstream Partners LP	4.75%	01/15/2031	18,166	14,761,734	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.25%	05/15/2026	2,159	2,045,031	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.50%	10/01/2025	2,642	2,548,379	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	7.75%	02/01/2028	34,229	32,844,793	0.2
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	8.00%	01/15/2027	17,227	16,837,229	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	6.88%	01/15/2029	11,607	10,832,884	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	7.00%	08/01/2027	7,835	7,486,876	0.0
Harbour Energy PLC	5.50%	10/15/2026	7,343	6,743,910	0.0
Hess Midstream Operations LP	4.25%	02/15/2030	206	173,840	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	5.75%	02/01/2029	5,408	4,907,548	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	6.00%	02/01/2031	7,941	7,151,645	0.0
Ithaca Energy North Sea PLC	9.00%	07/15/2026	6,979	6,874,396	0.0
ITT Holdings LLC	6.50%	08/01/2029	36,137	29,715,486	0.2
Nabors Industries, Inc.	7.38%	05/15/2027	17,675	17,003,792	0.1
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	02/01/2026	35,688	34,073,317	0.2
NuStar Logistics LP	6.38%	10/01/2030	4,368	4,088,623	0.0
Occidental Petroleum Corp.	5.88%	09/01/2025	5,779	5,778,956	0.0
Occidental Petroleum Corp.	6.13%	01/01/2031	4,679	4,711,778	0.0
Occidental Petroleum Corp.	8.50%	07/15/2027	5,994	6,430,205	0.0
Occidental Petroleum Corp.	8.88%	07/15/2030	6,994	7,949,351	0.0
PDC Energy, Inc.	5.75%	05/15/2026	8,594	8,238,086	0.1
Southwestern Energy Co.	5.38%	02/01/2029	3,267	3,057,051	0.0
Summit Midstream Holdings LLC/ Summit Midstream Finance Corp.	8.50%	10/15/2026	14,264	13,561,892	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp.	6.00%	12/31/2030	USD 3,062	\$ 2,640,927	0.0%
Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp.	6.00%	09/01/2031	1,333	1,139,527	0.0
				<u>398,384,869</u>	<u>2.2</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
ADT Security Corp. (The)	4.88%	07/15/2032	1,314	1,127,150	0.0
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	6.63%	07/15/2026	48,602	46,198,885	0.3
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL	4.63%	06/01/2028	21,890	18,182,218	0.1
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027	14,450	13,948,579	0.1
Aramark Services, Inc.	5.00%	02/01/2028	699	642,941	0.0
Aramark Services, Inc.	6.38%	05/01/2025	13,856	13,785,776	0.1
Block, Inc.	3.50%	06/01/2031	1,879	1,518,582	0.0
Cars.com, Inc.	6.38%	11/01/2028	13,634	12,509,158	0.1
Garda World Security Corp.	4.63%	02/15/2027	2,000	1,777,467	0.0
Garda World Security Corp.	7.75%	02/15/2028	23,601	23,158,569	0.1
Millennium Escrow Corp.	6.63%	08/01/2026	24,610	16,372,507	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC	5.50%	09/01/2028	34,619	26,158,943	0.1
Neptune Bidco US, Inc.	9.29%	04/15/2029	44,194	41,809,650	0.2
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.25%	04/15/2024	9,896	9,747,328	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.75%	04/15/2026	12,000	11,588,037	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	6.25%	01/15/2028	23,901	22,167,780	0.1
Ritchie Bros Auctioneers, Inc.	5.38%	01/15/2025	575	574,876	0.0
Sabre GLBL, Inc.	7.38%	09/01/2025	4,660	4,379,214	0.0
Sabre GLBL, Inc.	9.25%	04/15/2025	17,308	17,031,400	0.1
Sabre GLBL, Inc.	11.25%	12/15/2027	37,289	37,239,896	0.2
TripAdvisor, Inc.	7.00%	07/15/2025	8,071	8,099,858	0.0
WASH Multifamily Acquisition, Inc.	5.75%	04/15/2026	7,706	7,171,350	0.0
ZipRecruiter, Inc.	5.00%	01/15/2030	41,847	35,145,468	0.2
				<u>370,335,632</u>	<u>2.0</u>
TECHNOLOGIE					
CommScope, Inc.	4.75%	09/01/2029	25,086	20,451,271	0.1
CommScope, Inc.	6.00%	03/01/2026	2,210	2,129,266	0.0
Dell International LLC/EMC Corp.	5.85%	07/15/2025	6,238	6,280,787	0.0
Entegris Escrow Corp.	5.95%	06/15/2030	12,650	11,796,645	0.1
Gen Digital, Inc.	6.75%	09/30/2027	24,207	23,803,441	0.1
Gen Digital, Inc.	7.13%	09/30/2030	22,433	21,866,913	0.1
GoTo Group, Inc.	5.50%	09/01/2027	3,670	1,759,682	0.0
NCR Corp.	5.75%	09/01/2027	10,329	10,052,804	0.1
NCR Corp.	6.13%	09/01/2029	7,437	7,230,587	0.0
Playtika Holding Corp.	4.25%	03/15/2029	2,419	1,982,013	0.0
Presidio Holdings, Inc.	4.88%	02/01/2027	14,559	13,288,516	0.1
Seagate HDD Cayman	4.09%	06/01/2029	5,300	4,559,986	0.0
Sensata Technologies BV	5.88%	09/01/2030	10,263	9,774,356	0.1
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.	7.50%	09/01/2025	76,800	59,157,943	0.3
				<u>194,134,210</u>	<u>1.0</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Allegiant Travel Co.	7.25%	08/15/2027	10,577	10,391,903	0.1
American Airlines, Inc.	11.75%	07/15/2025	5,000	5,478,358	0.0
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.50%	04/20/2026	8,593	8,377,875	0.0
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.75%	04/20/2029	13,211	12,552,494	0.1
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd./ HawaiianMiles Loyalty Ltd.	5.75%	01/20/2026	14,686	13,654,630	0.1
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.	8.00%	09/20/2025	4,213	4,229,892	0.0
				<u>54,685,152</u>	<u>0.3</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Albion Financing 1 SARL/Aggreko Holdings, Inc.	6.13%	10/15/2026	19,507	17,479,231	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	4.75%	04/01/2028	17,737	15,787,787	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.38%	03/01/2029	23,207	21,017,032	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.75%	07/15/2027	5,000	4,721,742	0.0
PROG Holdings, Inc.	6.00%	11/15/2029	16,432	13,967,665	0.1
				<u>72,973,457</u>	<u>0.4</u>
				<u>3,605,332,495</u>	<u>19.5</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Banco Santander SA(a)	7.50%	02/08/2024	18,600	18,254,358	0.1
Bread Financial Holdings, Inc.	4.75%	12/15/2024	33,539	31,077,138	0.2
Bread Financial Holdings, Inc.	7.00%	01/15/2026	15,902	14,887,084	0.1
Credit Suisse Group AG(a)	6.25%	12/18/2024	45,694	37,670,268	0.3
Credit Suisse Group AG(a)	7.50%	07/17/2023	32,754	28,694,406	0.1
Credit Suisse Group AG(a)	7.50%	12/11/2023	25,000	22,889,546	0.1
Credit Suisse Group AG(a)	9.75%	06/23/2027	1,083	973,295	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Societe Generale SA(a)	7.88%	12/18/2023	USD 9,332	\$ 9,285,340	0.0%
Societe Generale SA(a)	8.00%	09/29/2025	16,232	16,178,555	0.1
				<u>179,909,990</u>	<u>1.0</u>
MAKLER					
AG TTMT Escrow Issuer LLC	8.63%	09/30/2027	28,521	28,941,187	0.2
Jane Street Group/JSG Finance, Inc.	4.50%	11/15/2029	17,383	15,245,922	0.1
NFP Corp.	4.88%	08/15/2028	8,605	7,554,813	0.0
NFP Corp.	7.50%	10/01/2030	17,419	16,615,717	0.1
				<u>68,357,639</u>	<u>0.4</u>
FINANZEN					
Aircastle Ltd.(a)	5.25%	06/15/2026	15,194	12,278,786	0.1
Castlelake Aviation Finance DAC	5.00%	04/15/2027	10,524	9,463,580	0.1
goeasy Ltd.	5.38%	12/01/2024	21,183	20,201,290	0.1
Jefferies Finance LLC/JFIN Co-Issuer Corp.	5.00%	08/15/2028	33,402	28,290,583	0.1
SLM Corp.	3.13%	11/02/2026	889	766,934	0.0
Synchrony Financial	7.25%	02/02/2033	8,891	8,538,205	0.0
				<u>79,539,378</u>	<u>0.4</u>
VERSICHERUNGEN					
Acrisure LLC / Acrisure Finance, Inc.	4.25%	02/15/2029	2,195	1,789,788	0.0
REITs					
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	4.50%	04/01/2027	29,109	24,926,011	0.1
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	5.75%	05/15/2026	9,735	8,964,906	0.0
Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2029	10,460	9,146,545	0.1
Iron Mountain, Inc.	5.00%	07/15/2028	10,020	9,079,444	0.0
Iron Mountain, Inc.	5.25%	03/15/2028	11,339	10,436,603	0.1
				<u>62,553,509</u>	<u>0.3</u>
				<u>392,150,304</u>	<u>2.1</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Calpine Corp.	5.13%	03/15/2028	21,905	19,427,742	0.1
NRG Energy, Inc.	3.88%	02/15/2032	14,124	10,948,800	0.1
Terraform Global Operating LP	6.13%	03/01/2026	7,871	7,548,296	0.0
Vistra Corp.(a)	7.00%	12/15/2026	16,102	15,076,047	0.1
Vistra Corp.(a)	8.00%	10/15/2026	19,514	18,811,270	0.1
Vistra Operations Co. LLC	5.63%	02/15/2027	18,523	17,573,333	0.1
				<u>89,385,488</u>	<u>0.5</u>
ERDGAS					
AmeriGas Partners LP/AmeriGas Finance Corp.	5.75%	05/20/2027	3,557	3,290,698	0.0
AmeriGas Partners LP/AmeriGas Finance Corp.	5.88%	08/20/2026	2,650	2,498,890	0.0
				<u>5,789,588</u>	<u>0.0</u>
				<u>95,175,076</u>	<u>0.5</u>
				<u>4,092,657,875</u>	<u>22.1</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Absa Group Ltd.(a)	6.38%	05/27/2026	4,093	3,805,978	0.0
Banco de Credito del Peru S.A.	3.13%	07/01/2030	20,748	18,800,282	0.1
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	5.38%	04/17/2025	23,905	23,695,831	0.1
BBVA Bancomer SA/Texas	5.88%	09/13/2034	26,946	24,896,420	0.2
				<u>71,198,511</u>	<u>0.4</u>
FINANZEN					
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	4.75%	04/27/2027	400	345,075	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd.	5.50%	01/16/2025	39,399	37,128,632	0.2
				<u>37,473,707</u>	<u>0.2</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
OEC Finance Ltd.(e)	4.38%	10/25/2029	5,188	142,619	0.0
OEC Finance Ltd.(e)	7.13%	12/26/2046	13,571	453,679	0.0
				<u>596,298</u>	<u>0.0</u>
REITs					
China Aoyuan Group Ltd.(f)	5.38%	09/13/2022	531	51,773	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(g)	5.88%	03/01/2027	5,486	521,170	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(g)	5.98%	08/18/2025	433	41,135	0.0
China Aoyuan Group Ltd.(f)	7.95%	02/19/2023	913	86,735	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	4.90%	05/13/2026	442	119,340	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	6.25%	08/10/2024	364	101,192	0.0
Shimao Group Holdings Ltd.(g)	5.20%	01/16/2027	1,491	249,742	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Shimao Group Holdings Ltd.(g)	5.60%	07/15/2026	USD 270	\$ 45,225	0.0%
Times China Holdings Ltd.(g)	5.55%	06/04/2024	2,235	367,099	0.0
Times China Holdings Ltd.(g)	5.75%	01/14/2027	1,726	274,326	0.0
Times China Holdings Ltd.(g)	6.60%	03/02/2023	490	78,645	0.0
Times China Holdings Ltd.(g)	6.75%	07/08/2025	703	108,965	0.0
Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030	29,404	25,111,016	0.1
Yango Justice International Ltd.(g)	7.50%	04/15/2024	727	18,175	0.0
Yango Justice International Ltd.(g)	7.50%	02/17/2025	6,715	167,875	0.0
Yango Justice International Ltd.(g)	7.88%	09/04/2024	997	24,925	0.0
Yango Justice International Ltd.(g)	8.25%	11/25/2023	1,343	33,575	0.0
Yango Justice International Ltd.(g)	9.25%	04/15/2023	630	15,750	0.0
Yango Justice International Ltd.(f)	10.25%	09/15/2022	335	8,375	0.0
				<u>27,425,038</u>	<u>0.1</u>
				<u>136,693,554</u>	<u>0.7</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Anglo American Capital PLC	5.63%	04/01/2030	40,450	40,015,971	0.2
Braskem Idesa SAPI	6.99%	02/20/2032	28,731	20,039,873	0.1
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029	4,456	3,442,260	0.0
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030	13,480	11,316,393	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	7.25%	02/13/2033	8,079	7,890,926	0.1
Cia de Minas Buenaventura SAA	5.50%	07/23/2026	2,050	1,722,384	0.0
CSN Inova Ventures	6.75%	01/28/2028	11,082	10,524,963	0.1
CSN Resources SA	4.63%	06/10/2031	24,154	18,923,451	0.1
Eldorado Gold Corp.	6.25%	09/01/2029	12,403	10,906,206	0.1
Freeport Indonesia PT	4.76%	04/14/2027	5,354	5,137,498	0.0
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.	5.13%	05/15/2024	8,685	8,534,641	0.1
Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	8.25%	10/22/2025	22,607	22,098,343	0.1
Industrias Penoles SAB de CV	5.65%	09/12/2049	4,016	3,660,333	0.0
JSW Steel Ltd.	5.05%	04/05/2032	2,538	2,049,118	0.0
Nexa Resources SA	5.38%	05/04/2027	8,310	7,812,958	0.0
OCP SA	3.75%	06/23/2031	6,361	5,128,556	0.0
Orbia Advance Corp. SAB de CV	2.88%	05/11/2031	2,059	1,613,741	0.0
Sasol Financing USA LLC.	5.88%	03/27/2024	8,684	8,559,819	0.1
Stillwater Mining Co.	4.00%	11/16/2026	5,644	5,009,050	0.0
Stillwater Mining Co.	4.50%	11/16/2029	5,188	4,261,618	0.0
Suzano Austria GmbH	3.75%	01/15/2031	5,486	4,615,098	0.0
Suzano Austria GmbH	5.00%	01/15/2030	9,588	8,808,975	0.1
Suzano Austria GmbH, Series DM3N	3.13%	01/15/2032	4,108	3,210,607	0.0
Vale Overseas Ltd.	3.75%	07/08/2030	20,000	17,319,000	0.1
Vedanta Resources Finance II PLC	8.95%	03/11/2025	20,226	13,450,290	0.1
Volcan Cia Minera SAA.	4.38%	02/11/2026	6,560	5,092,200	0.0
				<u>251,144,272</u>	<u>1.4</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Cemex SAB de CV	3.88%	07/11/2031	16,350	13,161,750	0.1
Cemex SAB de CV(a)	5.13%	06/08/2026	16,029	14,474,187	0.1
Cemex SAB de CV	7.38%	06/05/2027	6,522	6,597,003	0.0
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	26,107	24,854,517	0.1
Embraer Netherlands Finance BV	6.95%	01/17/2028	14,202	14,077,449	0.1
IHS Holding Ltd.	5.63%	11/29/2026	6,475	5,492,823	0.0
IHS Holding Ltd.	6.25%	11/29/2028	2,727	2,234,947	0.0
Usiminas International SARL	5.88%	07/18/2026	11,294	10,604,360	0.1
				<u>91,497,036</u>	<u>0.5</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030	10,669	8,617,218	0.0
Prosus NV	3.26%	01/19/2027	10,600	9,407,500	0.1
Prosus NV	4.03%	08/03/2050	7,314	4,581,764	0.0
Telecomunicaciones Digitales SA	4.50%	01/30/2030	886	713,784	0.0
Weibo Corp.	3.50%	07/05/2024	28,740	27,658,657	0.2
				<u>50,978,923</u>	<u>0.3</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
C&W Senior Financing DAC	6.88%	09/15/2027	20,667	18,685,599	0.1
CT Trust	5.13%	02/03/2032	3,175	2,505,954	0.0
HTA Group Ltd./Mauritius	7.00%	12/18/2025	20,951	19,802,623	0.1
Sable International Finance Ltd.	5.75%	09/07/2027	30,147	27,772,217	0.2
				<u>68,766,393</u>	<u>0.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Falabella SA.	3.38%	01/15/2032	17,800	13,548,025	0.1
Falabella SA.	3.75%	10/30/2027	4,335	3,844,495	0.0
				<u>17,392,520</u>	<u>0.1</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
BRF GmbH	4.35%	09/29/2026	USD 4,994	\$ 4,336,290	0.0%
BRF SA	4.88%	01/24/2030	27,471	20,852,549	0.1
Central American Bottling Corp./CBC Bottling Holdco SL/ Beliv Holdco SL	5.25%	04/27/2029	5,267	4,825,889	0.0
Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV	2.43%	07/01/2031	10,259	8,335,437	0.0
MARB BondCo PLC	3.95%	01/29/2031	20,366	14,561,690	0.1
Natura & Co. Luxembourg Holdings SARL	6.00%	04/19/2029	16,126	13,416,832	0.1
Natura Cosmetics SA	4.13%	05/03/2028	15,284	11,868,026	0.1
NBM US Holdings, Inc.	6.63%	08/06/2029	10,000	9,108,125	0.1
Rede D'or Finance SARL	4.50%	01/22/2030	5,927	4,986,830	0.0
Rede D'or Finance SARL	4.95%	01/17/2028	4,189	3,793,139	0.0
Ulker Biskuvi Sanayi AS	6.95%	10/30/2025	3,907	3,320,462	0.0
				<u>99,405,269</u>	<u>0.5</u>
ENERGIE					
Acu Petroleo Luxembourg SARL	7.50%	01/13/2032	10,872	9,806,592	0.1
Ecopetrol SA	4.63%	11/02/2031	5,838	4,308,444	0.0
Ecopetrol SA	5.88%	11/02/2051	7,071	4,513,419	0.0
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	24,762	22,038,180	0.1
Ecopetrol SA	8.88%	01/13/2033	4,812	4,703,730	0.0
Geopark Ltd.	5.50%	01/17/2027	10,200	8,582,663	0.0
Gran Tierra Energy, Inc.	7.75%	05/23/2027	9,886	8,081,505	0.0
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.	5.50%	04/06/2025	10,110	9,514,774	0.1
HPCL-Mittal Energy Ltd.	5.45%	10/22/2026	2,624	2,498,212	0.0
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	6.38%	06/01/2028	1,769	1,649,349	0.0
Medco Platinum Road Pte Ltd.	6.75%	01/30/2025	5,600	5,485,550	0.0
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034	10,442	9,370,023	0.1
Oleoducto Central SA	4.00%	07/14/2027	8,487	7,279,194	0.0
Peru LNG SRL	5.38%	03/22/2030	11,304	8,944,290	0.1
Raizen Fuels Finance SA	5.30%	01/20/2027	16,179	15,570,265	0.1
ReNew Power Pvt Ltd.	5.88%	03/05/2027	270	256,719	0.0
SEPLAT Energy PLC	7.75%	04/01/2026	11,120	9,354,700	0.1
SierraCol Energy Andina LLC	6.00%	06/15/2028	11,150	8,706,059	0.1
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	3.25%	08/15/2030	11,464	8,598,000	0.1
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	4.00%	08/15/2026	25,480	22,422,400	0.1
Transportadora de Gas Internacional SA ESP	5.55%	11/01/2028	4,600	4,361,720	0.0
				<u>176,045,788</u>	<u>1.0</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Bidvest Group UK PLC (The)	3.63%	09/23/2026	9,421	8,359,960	0.0
TECHNOLOGIE					
Baidu, Inc.	3.43%	04/07/2030	345	305,073	0.0
CA Magnum Holdings	5.38%	10/31/2026	26,695	24,359,188	0.1
Lenovo Group Ltd.	3.42%	11/02/2030	12,000	9,793,320	0.1
Lenovo Group Ltd.	5.83%	01/27/2028	873	857,120	0.0
Lenovo Group Ltd.	6.54%	07/27/2032	4,000	3,890,750	0.0
				<u>39,205,451</u>	<u>0.2</u>
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN					
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	20,746	17,893,151	0.1
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	5.88%	07/05/2034	8,839	8,385,576	0.0
				<u>26,278,727</u>	<u>0.1</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	4.00%	07/30/2027	23,925	19,024,861	0.1
JSW Infrastructure Ltd.	4.95%	01/21/2029	3,094	2,649,818	0.0
				<u>21,674,679</u>	<u>0.1</u>
				<u>850,749,018</u>	<u>4.6</u>
STAATSANLEIHEN					
ANGOLA					
Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029	17,946	16,241,130	0.1
Angolan Government International Bond	9.50%	11/12/2025	12,861	12,957,457	0.1
				<u>29,198,587</u>	<u>0.2</u>
BRASILIEN					
Brazilian Government International Bond	8.25%	01/20/2034	15,326	17,287,728	0.1
KOLUMBIEN					
Colombia Government International Bond	3.13%	04/15/2031	4,454	3,223,026	0.0
Colombia Government International Bond	3.25%	04/22/2032	47,384	33,500,488	0.2
Colombia Government International Bond	5.63%	02/26/2044	7,843	5,619,510	0.0
Colombia Government International Bond	6.13%	01/18/2041	33,529	26,169,384	0.1
Colombia Government International Bond	7.38%	09/18/2037	9,114	8,435,007	0.1
				<u>76,947,415</u>	<u>0.4</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					
Dominican Republic International Bond	4.50%	01/30/2030	USD 69,271	\$ 59,347,929	0.3%
Dominican Republic International Bond	4.88%	09/23/2032	19,203	16,044,107	0.1
Dominican Republic International Bond	5.50%	02/22/2029	6,306	5,834,232	0.0
Dominican Republic International Bond	6.00%	07/19/2028	8,000	7,696,500	0.1
Dominican Republic International Bond	8.63%	04/20/2027	2,096	2,180,888	0.0
				<u>91,103,656</u>	<u>0.5</u>
ECUADOR					
Ecuador Government International Bond	1.50%	07/31/2040	9,839	3,051,815	0.0
Ecuador Government International Bond	2.50%	07/31/2035	32,419	11,322,495	0.1
Ecuador Government International Bond	5.50%	07/31/2030	8,737	4,217,275	0.0
				<u>18,591,585</u>	<u>0.1</u>
ÄGYPTEN					
Egypt Government International Bond	6.59%	02/21/2028	9,640	7,495,100	0.1
Egypt Government International Bond	7.05%	01/15/2032	6,969	4,862,184	0.0
Egypt Government International Bond	7.50%	01/31/2027	41,608	35,574,840	0.2
Egypt Government International Bond	7.63%	05/29/2032	62,112	43,858,836	0.2
				<u>91,790,960</u>	<u>0.5</u>
EL SALVADOR					
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	15,000	7,901,250	0.1
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	9,532	4,246,506	0.0
El Salvador Government International Bond	8.63%	02/28/2029	13,501	6,723,498	0.0
				<u>18,871,254</u>	<u>0.1</u>
ELFENBEINKÜSTE					
Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	18,113	15,577,180	0.1
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	39,769	37,581,705	0.2
				<u>53,158,885</u>	<u>0.3</u>
KENIA					
Republic of Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027	19,297	17,270,815	0.1
Republic of Kenya Government International Bond	7.25%	02/28/2028	11,890	10,269,987	0.0
				<u>27,540,802</u>	<u>0.1</u>
NIGERIA					
Nigeria Government International Bond	6.13%	09/28/2028	7,834	6,198,653	0.0
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047	13,971	9,325,642	0.1
Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	12,210	8,484,424	0.0
Nigeria Government International Bond	7.88%	02/16/2032	3,948	3,030,090	0.0
				<u>27,038,809</u>	<u>0.1</u>
PANAMA					
Panama Notas del Tesoro	3.75%	04/17/2026	30,363	28,518,448	0.2
SENEGAL					
Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	43,004	35,424,545	0.2
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	22,447	15,740,959	0.1
				<u>51,165,504</u>	<u>0.3</u>
SÜDAFRIKA					
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	45,168	32,803,260	0.1
Republic of South Africa Government International Bond	6.30%	06/22/2048	14,391	11,314,924	0.1
				<u>44,118,184</u>	<u>0.2</u>
UKRAINE					
Ukraine Government International Bond	7.25%	03/15/2035	32,227	5,474,562	0.0
Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2034	68,051	11,670,746	0.1
Ukraine Government International Bond	8.99%	02/01/2026	10,000	1,861,250	0.0
				<u>19,006,558</u>	<u>0.1</u>
				<u>594,338,375</u>	<u>3.2</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Adani Transmission Step-One Ltd.	4.00%	08/03/2026	15,853	13,237,255	0.1
AES Andes SA	6.35%	10/07/2079	12,300	11,654,250	0.1
AES Panama Generation Holdings SRL	4.38%	05/31/2030	11,919	10,417,206	0.1
Cometa Energia SA de CV	6.38%	04/24/2035	7,997	7,735,776	0.0
Consorcio Transmantaro SA	5.20%	04/11/2038	9,670	8,599,047	0.0
Empresa Electrica Cochane SpA	5.50%	05/14/2027	5,248	4,896,769	0.0
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.25%	07/18/2029	24,989	18,285,701	0.1
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.38%	02/15/2031	19,852	13,986,975	0.1
Engie Energia Chile SA	4.50%	01/29/2025	9,400	8,638,694	0.0
India Clean Energy Holdings	4.50%	04/18/2027	13,448	10,441,531	0.1
Infraestructura Energetica Nova SAPI de CV	3.75%	01/14/2028	7,817	7,051,423	0.0
Investment Energy Resources Ltd.	6.25%	04/26/2029	11,154	9,961,916	0.1
JSW Hydro Energy Ltd.	4.13%	05/18/2031	3,161	2,588,842	0.0
Kallpa Generacion SA	4.13%	08/16/2027	10,259	9,324,790	0.1

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA	4.38%	06/18/2026	USD 5,341	\$ 2,288,618	0.0%
LLPL Capital Pte Ltd.	6.88%	02/04/2039	9,192	8,342,093	0.0
Minejesa Capital BV	4.63%	08/10/2030	9,000	8,010,990	0.0
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	6.75%	04/24/2033	11,556	11,142,412	0.1
				<u>166,604,288</u>	<u>0.9</u>
ERDGAS					
GNL Quintero SA	4.63%	07/31/2029	9,331	8,909,518	0.1
				<u>175,513,806</u>	<u>1.0</u>
				<u>1,757,294,753</u>	<u>9.5</u>
BEHÖRDEN					
SCHULDVERSCHREIBUNGEN VON BEHÖRDEN					
Federal Home Loan Banks	3.25%	06/09/2028	34,000	32,269,896	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp.	6.25%	07/15/2032	119,285	138,288,484	0.8
Federal Home Loan Mortgage Corp.	6.75%	03/15/2031	65,181	76,499,477	0.4
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series GDIF	6.75%	09/15/2029	8,750	9,993,636	0.1
Federal National Mortgage Association	6.25%	05/15/2029	120,037	133,280,416	0.7
Federal National Mortgage Association	6.63%	11/15/2030	358,671	415,540,808	2.2
Federal National Mortgage Association	7.13%	01/15/2030	142,912	167,935,710	0.9
Federal National Mortgage Association	7.25%	05/15/2030	15,000	17,836,926	0.1
Tennessee Valley Authority	7.13%	05/01/2030	19,383	22,528,050	0.1
				<u>1,014,173,403</u>	<u>5.5</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB FCPI - Emerging Markets Debt Portfolio - Class SA			698,229	44,505,103	0.2
AB SICAV I - Asia Income Opportunities Portfolio - Class ZT			3,400,286	278,075,383	1.5
AB SICAV I - Global Income Portfolio			1,119,556	87,045,475	0.5
AB SICAV I - Short Duration Income Portfolio			897,588	85,710,656	0.5
AB SICAV I - Sustainable Income Portfolio			856,251	75,392,868	0.4
AB SICAV I - US High Yield Portfolio - Class ZT			4,193,318	53,506,737	0.3
				<u>624,236,222</u>	<u>3.4</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2018-3A, Class M1B(c)	6.47%	10/25/2028	USD 286	285,964	0.0
Series 2019-1A, Class M2(c)	7.32%	03/25/2029	12,777	12,893,832	0.1
Series 2019-2A, Class M1C(c)	6.62%	04/25/2029	17,169	17,182,880	0.1
Series 2019-2A, Class M2(c)	7.71%	04/25/2029	5,000	5,087,124	0.0
Series 2019-3A, Class M1C(c)	6.57%	07/25/2029	49,916	49,826,850	0.3
Series 2019-4A, Class M1C(c)	7.12%	10/25/2029	20,431	20,528,823	0.1
Series 2019-4A, Class M2(c)	7.47%	10/25/2029	40,849	41,403,715	0.2
Series 2020-3A, Class M2(c)	9.47%	10/25/2030	4,250	4,412,977	0.0
Connecticut Avenue Securities Trust,					
Series 2022-R07, Class 1M1(c)	7.44%	06/25/2042	206	210,159	0.0
Eagle Re Ltd.					
Series 2018-1, Class M1(c)	6.32%	11/25/2028	2,145	2,144,401	0.0
Series 2019-1, Class M1B(c)	6.42%	04/25/2029	1,278	1,278,125	0.0
Series 2020-1, Class M2(c)	6.62%	01/25/2030	15,704	15,181,892	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2014-DN4, Class M3(c)	9.17%	10/25/2024	5,191	5,282,124	0.0
Series 2014-HQ2, Class M3(c)	8.37%	09/25/2024	1,307	1,337,226	0.0
Series 2015-HQA1, Class M3(c)	9.31%	03/25/2028	9,607	9,901,860	0.1
Series 2015-HQA2, Class M3(c)	9.42%	05/25/2028	10,386	10,810,270	0.1
Series 2016-HQA3, Class M3(c)	8.47%	03/25/2029	1,771	1,842,589	0.0
Federal National Mortgage Association					
Connecticut Avenue Securities					
Series 2013-C01, Class M2(c)	9.87%	10/25/2023	1,395	1,429,284	0.0
Series 2014-C01, Class M2(c)	9.02%	01/25/2024	1,105	1,134,637	0.0
Series 2014-C03, Class 2M2(c)	7.52%	07/25/2024	341	346,412	0.0
Series 2014-C04, Class 1M2(c)	9.52%	11/25/2024	7,074	7,359,463	0.0
Series 2014-C04, Class 2M2(c)	9.62%	11/25/2024	207	208,697	0.0
Series 2015-C04, Class 2M2(c)	10.17%	04/25/2028	18,051	18,857,321	0.1
Series 2016-C01, Class 1M2(c)	11.37%	08/25/2028	8,193	8,678,319	0.1
Series 2016-C01, Class 2M2(c)	11.56%	08/25/2028	5,340	5,656,323	0.0
Series 2016-C02, Class 1M2(c)	10.61%	09/25/2028	15,858	16,640,259	0.1
Series 2016-C03, Class 1M2(c)	9.92%	10/25/2028	10,041	10,692,427	0.1
Series 2017-C03, Class 1B1(c)	9.47%	10/25/2029	10,420	11,246,921	0.1
Home Re Ltd., Series 2019-1, Class M2(c)	7.87%	05/25/2029	5,400	5,461,723	0.0
Oaktown Re II Ltd., Series 2018-1A, Class M1(c)	6.17%	07/25/2028	380	380,104	0.0
Oaktown Re V Ltd., Series 2020-2A, Class M2(c)	9.87%	10/25/2030	3,942	4,023,332	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
PMT Credit Risk Transfer Trust					
Series 2019-2R, Class A(c)	7.26%	05/27/2023	USD 13,742	\$ 13,561,831	0.1%
Series 2019-3R, Class A(c)	8.36%	11/27/2031	4,330	4,240,576	0.0
Radnor Re Ltd.					
Series 2019-1, Class M1B(c)	6.57%	02/25/2029	12,742	12,736,846	0.1
Series 2019-1, Class M2(c)	7.82%	02/25/2029	9,912	9,935,105	0.1
Series 2020-1, Class M1B(c)	6.07%	01/25/2030	22,546	22,501,120	0.1
Series 2020-1, Class M1C(c)	6.37%	01/25/2030	8,262	8,209,139	0.0
				362,910,650	2.0
VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 3119, Class PI(c) (h)	2.61%	02/15/2036	3,324	420,074	0.0
Series 3725, Class CS(c) (h)	1.41%	05/15/2040	18,775	901,997	0.0
Series 3898, Class NS(c) (h)	1.34%	07/15/2041	5,172	314,954	0.0
Series 3921, Class SB(c) (h)	1.97%	09/15/2041	11,163	1,171,298	0.0
Series 3928, Class SE(c) (h)	1.99%	09/15/2041	9,879	1,012,737	0.0
Series 4125, Class SA(c) (h)	1.56%	11/15/2042	6,521	610,235	0.0
Series 4248, Class SL(c) (h)	1.46%	05/15/2041	1,884	115,179	0.0
Series 4292, Class S(c) (h)	1.46%	01/15/2044	2,317	231,701	0.0
Series 4317, Class SD(c) (h)	2.61%	08/15/2035	5,744	643,963	0.0
Series 4372, Class JS(c) (h)	1.51%	08/15/2044	14,344	1,234,947	0.0
Series 4373, Class SA(c) (h)	1.56%	08/15/2044	8,810	828,359	0.0
Series 4494, Class SL(c) (h)	1.63%	07/15/2045	29,388	2,752,142	0.1
Series 4495, Class SA(c) (h)	1.56%	07/15/2045	6,828	708,061	0.0
Series 4570, Class ST(c) (h)	1.41%	04/15/2046	7,888	748,626	0.0
Series 4585, Class DS(c) (h)	1.41%	05/15/2046	14,728	1,362,495	0.0
Series 4593, Class SA(c) (h)	1.41%	06/15/2046	10,398	911,162	0.0
Series 4656, Class SK(c) (h)	1.46%	02/15/2047	7,486	692,603	0.0
Series 4707, Class LS(c) (h)	1.56%	08/15/2047	8,888	871,574	0.0
Series 4719, Class SA(c) (h)	1.56%	09/15/2047	7,728	832,926	0.0
Series 4719, Class SB(c) (h)	1.56%	09/15/2047	14,976	1,518,391	0.0
Series 4727, Class AS(c) (h)	1.61%	11/15/2047	12,417	1,329,674	0.0
Series 4735, Class SA(c) (h)	1.61%	12/15/2047	23,378	2,309,684	0.0
Series 4736, Class LS(c) (h)	1.61%	12/15/2047	10,452	1,123,234	0.0
Series 4736, Class SM(c) (h)	1.61%	12/15/2047	20,981	2,081,952	0.0
Series 4754, Class QS(c) (h)	1.56%	02/15/2048	12,205	1,349,177	0.0
Series 4767, Class SB(c) (h)	1.61%	03/15/2048	5,031	479,748	0.0
Series 4824, Class KS(c) (h)	1.61%	09/15/2048	4,828	488,872	0.0
Series 4927, Class SJ(c) (h)	1.43%	11/25/2049	14,883	1,901,220	0.0
Series 4932, Class SM(c) (h)	1.43%	06/25/2049	22,819	1,974,082	0.0
Series 4954, Class SL(c) (h)	1.43%	02/25/2050	251	23,204	0.0
Series 4981, Class HS(c) (h)	1.48%	06/25/2050	67,321	5,883,474	0.1
Series 4981, Class JS(c) (h)	1.48%	06/25/2050	104,067	12,069,446	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2005-58, Class IK(c) (h)	1.38%	07/25/2035	6,783	630,458	0.0
Series 2006-8, Class JH(c) (h)	1.98%	03/25/2036	7,820	775,874	0.0
Series 2011-146, Class SA(c) (h)	1.38%	01/25/2042	8,024	719,087	0.0
Series 2012-122, Class LS(c) (h)	1.48%	11/25/2042	7,015	652,623	0.0
Series 2012-122, Class MS(c) (h)	1.48%	11/25/2042	7,554	794,703	0.0
Series 2012-17, Class ES(c) (h)	1.93%	03/25/2041	1,091	27,405	0.0
Series 2012-17, Class SE(c) (h)	1.33%	03/25/2042	7,524	823,077	0.0
Series 2012-7, Class QS(c) (h)	1.38%	02/25/2042	10,310	916,586	0.0
Series 2012-70, Class HS(c) (h)	1.38%	07/25/2042	11,922	1,255,419	0.0
Series 2013-15, Class SA(c) (h)	1.53%	03/25/2043	6,268	607,714	0.0
Series 2013-4, Class ST(c) (h)	1.53%	02/25/2043	7,094	684,577	0.0
Series 2013-62, Class SA(c) (h)	2.08%	06/25/2043	9,939	1,355,342	0.0
Series 2014-17, Class SB(c) (h)	1.43%	04/25/2044	7,783	756,931	0.0
Series 2014-28, Class SB(c) (h)	1.43%	05/25/2044	7,078	796,866	0.0
Series 2014-35, Class CS(c) (h)	1.53%	06/25/2044	10,685	693,839	0.0
Series 2014-40, Class HS(c) (h)	2.08%	07/25/2044	4,790	682,175	0.0
Series 2014-78, Class SA(c) (h)	1.48%	12/25/2044	4,113	437,797	0.0
Series 2014-88, Class BS(c) (h)	1.53%	01/25/2045	6,811	633,475	0.0
Series 2015-26, Class SH(c) (h)	1.83%	05/25/2045	10,265	1,182,905	0.0
Series 2015-57, Class AS(c) (h)	1.63%	08/25/2045	39,682	2,534,596	0.1
Series 2015-90, Class SL(c) (h)	1.53%	12/25/2045	8,601	817,615	0.0
Series 2016-29, Class SA(c) (h)	1.38%	05/25/2046	9,846	917,584	0.0
Series 2016-60, Class SA(c) (h)	1.48%	09/25/2046	23,132	1,467,235	0.0
Series 2016-65, Class AS(c) (h)	1.48%	09/25/2046	10,339	818,542	0.0
Series 2016-89, Class SH(c) (h)	1.38%	12/25/2046	5,380	489,807	0.0
Series 2017-105, Class SE(c) (h)	1.53%	01/25/2048	34,712	3,461,870	0.1
Series 2017-109, Class SJ(c) (h)	1.58%	01/25/2048	2,934	317,174	0.0
Series 2017-112, Class SA(c) (h)	1.53%	01/25/2048	9,715	952,244	0.0
Series 2017-20, Class SJ(c) (h)	1.48%	04/25/2047	21,124	2,057,853	0.0
Series 2017-26, Class TS(c) (h)	1.33%	04/25/2047	7,381	740,389	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2017-35, Class LS(c) (h)	1.53%	05/25/2047	USD 22,792	\$ 2,296,393	0.0%
Series 2017-38, Class DS(c) (h)	1.58%	05/25/2047	6,727	336,948	0.0
Series 2017-38, Class SE(c) (h)	1.48%	05/25/2047	15,872	1,552,560	0.0
Series 2017-49, Class SP(c) (h)	1.53%	07/25/2047	6,717	666,838	0.0
Series 2017-81, Class CS(c) (h)	1.58%	10/25/2047	7,364	945,095	0.0
Series 2017-85, Class HS(c) (h)	1.58%	11/25/2047	11,988	1,147,594	0.0
Series 2018-13, Class SG(c) (h)	1.53%	03/25/2048	6,643	742,249	0.0
Series 2018-28, Class PS(c) (h)	1.58%	05/25/2048	12,160	1,210,571	0.0
Series 2018-28, Class SB(c) (h)	1.58%	05/25/2048	12,525	1,291,825	0.0
Series 2018-30, Class SA(c) (h)	1.58%	05/25/2048	12,102	1,158,958	0.0
Series 2018-32, Class SB(c) (h)	1.58%	05/25/2048	12,805	1,295,148	0.0
Series 2018-39, Class AS(c) (h)	1.58%	06/25/2048	5,974	802,122	0.0
Series 2018-45, Class SL(c) (h)	1.58%	06/25/2048	9,480	986,982	0.0
Series 2018-47, Class SD(c) (h)	1.58%	07/25/2048	19,508	2,092,678	0.0
Series 2018-63, Class KS(c) (h)	1.58%	09/25/2048	5,348	546,791	0.0
Series 2018-96, Class SC(c) (h)	1.43%	10/25/2035	4,966	295,600	0.0
Series 2019-13, Class SA(c) (h)	1.38%	04/25/2049	11,414	999,199	0.0
Series 2019-25, Class SA(c) (h)	1.43%	06/25/2049	27,789	2,643,853	0.1
Series 2019-31, Class SJ(c) (h)	1.48%	07/25/2049	6,023	524,148	0.0
Series 2019-37, Class US(c) (h)	1.43%	07/25/2049	9,087	776,730	0.0
Series 2019-38, Class SM(c) (h)	1.43%	07/25/2049	5,793	795,874	0.0
Series 2019-42, Class SQ(c) (h)	1.43%	08/25/2049	16,846	1,826,231	0.0
Series 2019-48, Class SA(c) (h)	1.58%	12/25/2039	21,963	2,172,956	0.0
Series 2019-48, Class SM(c) (h)	1.43%	07/25/2039	7,796	755,914	0.0
Series 2019-60, Class SJ(c) (h)	1.43%	10/25/2049	18,040	1,901,198	0.0
Series 2019-65, Class SY(c) (h)	1.43%	11/25/2049	12,281	1,406,929	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2014-160, Class SP(c) (h)	1.00%	10/20/2044	11,997	1,195,621	0.0
Series 2017-103, Class SL(c) (h)	1.60%	07/20/2047	14,657	1,181,317	0.0
Series 2017-115, Class SA(c) (h)	1.60%	07/20/2047	11,364	963,557	0.0
Series 2017-122, Class SA(c) (h)	1.60%	08/20/2047	14,425	1,495,542	0.0
Series 2017-134, Class SE(c) (h)	1.60%	09/20/2047	6,403	546,559	0.0
Series 2017-149, Class SG(c) (h)	1.60%	10/20/2047	10,778	935,153	0.0
Series 2017-52, Class SN(c) (h)	1.55%	04/20/2047	4,105	320,457	0.0
Series 2020-47, Class SG(c) (h)	1.40%	02/20/2049	13,636	1,114,369	0.0
				116,822,912	0.6
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 4398, Class IO(i)	6.00%	10/15/2037	11,782	2,149,333	0.0
Series 4913, Class IO(i)	6.00%	04/15/2041	5,426	1,100,502	0.0
Series 4933, Class IO(i)	5.00%	03/15/2049	6,734	1,046,159	0.0
Series 4976, Class MI(i)	4.50%	05/25/2050	30,571	6,328,798	0.1
Series 4981, Class MI(i)	5.00%	06/25/2050	43,583	9,002,853	0.1
Series 4987, Class IC(i)	4.50%	06/25/2050	104,405	17,962,496	0.1
Series 4993, Class LI(i)	5.00%	07/25/2050	12,735	2,625,975	0.0
Series 5008, Class AI(i)	3.50%	09/25/2050	14,334	2,289,148	0.0
Series 5011, Class MI(i)	3.00%	09/25/2050	13,962	2,218,841	0.0
Series 5013, Class JI(i)	4.00%	09/25/2050	23,707	3,578,373	0.0
Series 5015, Class BI(i)	4.00%	09/25/2050	19,413	3,787,715	0.0
Series 5018, Class AI(i)	4.00%	10/25/2050	10,195	1,882,688	0.0
Series 5018, Class GI(i)	4.50%	10/25/2050	16,298	2,958,555	0.0
Series 5024, Class DI(i)	4.00%	10/25/2050	5,025	874,979	0.0
Series 5030, Class EI(i)	3.50%	10/25/2050	4,943	820,038	0.0
Series 5036, Class IT(i)	4.00%	03/25/2050	6,617	1,205,618	0.0
Series 5040, Class AI(i)	3.50%	11/25/2050	2,050	338,694	0.0
Series 5043, Class IO(i)	5.00%	11/25/2050	13,880	3,050,887	0.0
Series 5049, Class CI(i)	3.50%	12/25/2050	23,066	4,072,708	0.1
Series 5052, Class IK(i)	4.00%	12/25/2050	20,697	3,785,628	0.0
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2010-109, Class IM(i)	5.50%	09/25/2040	1,945	276,043	0.0
Series 2014-37, Class AI(i)	5.50%	07/25/2044	3,969	765,120	0.0
Series 2015-22, Class EI(i)	6.00%	04/25/2045	17,226	3,088,558	0.0
Series 2016-11, Class GI(i)	5.00%	03/25/2046	3,553	623,890	0.0
Series 2016-26, Class IO(i)	5.00%	05/25/2046	12,526	1,948,267	0.0
Series 2016-33, Class NI(i)	5.00%	07/25/2034	14,794	2,551,971	0.0
Series 2016-34, Class AI(i)	5.00%	06/25/2046	12,906	2,013,334	0.0
Series 2016-37, Class BI(i)	5.00%	06/25/2046	23,194	3,859,921	0.1
Series 2016-64, Class BI(i)	5.00%	09/25/2046	20,812	3,073,182	0.0
Series 2018-54, Class IO(i)	5.50%	08/25/2048	7,327	1,566,017	0.0
Series 2020-89, Class KI(i)	4.00%	12/25/2050	70,772	13,342,449	0.1
Series 2020-96, Class KI(i)	2.50%	01/25/2051	6,885	1,072,595	0.0
Series 2021-18, Class IT(i)	3.00%	04/25/2051	12,852	2,117,952	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Government National Mortgage Association					
Series 2015-62, Class GI(i)	6.50%	05/20/2045	USD 14,169	\$ 2,494,692	0.0%
Series 2019-57, Class IO(i)	5.50%	05/20/2049	4,538	779,751	0.0
				<u>110,653,730</u>	<u>0.6</u>
				<u>590,387,292</u>	<u>3.2</u>
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	3.50%	09/01/2049	3,916	3,629,913	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	4.00%	08/01/2049	861	822,730	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	5.00%	11/01/2049	3,753	3,771,758	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	3.50%	10/01/2049	3,840	3,563,983	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	4.00%	09/01/2049	2,940	2,814,169	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	4.00%	10/01/2049	5,737	5,497,307	0.0
Ginnie Mae, Series 2022	3.00%	03/01/2053	225,053	200,759,401	1.1
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2023, TBA	4.50%	03/01/2053	102,045	98,245,816	0.6
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2023, TBA	5.00%	03/01/2053	100,693	98,946,398	0.6
				<u>418,051,475</u>	<u>2.3</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E	4.65%	02/10/2036	12,568	10,406,206	0.1
Banc of America Commercial Mortgage Trust, Series 2015-UBS7, Class AS	3.99%	09/15/2048	2,340	2,198,468	0.0
Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust, Series 2016-UB10, Class C	4.84%	07/15/2049	2,354	2,113,777	0.0
Benchmark Mortgage Trust, Series 2019-B11, Class XA(i)	1.00%	05/15/2052	213,368	9,173,573	0.1
CCUBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class XA(i)	1.01%	11/15/2050	6,144	212,944	0.0
CD Mortgage Trust, Series 2017-CD3, Class XA(i)	0.96%	02/10/2050	97,415	2,820,835	0.0
CFCRE Commercial Mortgage Trust, Series 2016-C4, Class AM	3.69%	05/10/2058	390	362,361	0.0
CGMS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-B1, Class C	4.12%	08/15/2050	9,500	8,174,605	0.1
Citigroup Commercial Mortgage Trust Series 2013-GC11, Class D	4.26%	04/10/2046	1,201	1,183,539	0.0
Series 2013-GC11, Class XA(i)	0.84%	04/10/2046	87	5	0.0
Series 2013-GC17, Class C	5.11%	11/10/2046	3,895	3,764,261	0.0
Series 2013-GC17, Class D	5.11%	11/10/2046	5,540	4,871,029	0.0
Series 2015-GC29, Class XA(i)	1.02%	04/10/2048	29,985	510,573	0.0
Series 2016-C3, Class XA(i)	1.00%	11/15/2049	158,302	4,597,907	0.0
Series 2016-P3, Class XA(i)	1.66%	04/15/2049	110,034	3,756,715	0.0
Series 2017-P7, Class XA(i)	1.11%	04/14/2050	77,577	2,713,225	0.0
Commercial Mortgage Trust Series 2012-CR2, Class G	4.25%	08/15/2045	8,500	4,240,121	0.0
Series 2012-CR3, Class D	4.64%	10/15/2045	3,971	2,871,959	0.0
Series 2012-CR3, Class E	4.64%	10/15/2045	2,959	1,710,369	0.0
Series 2012-CR5, Class C	4.40%	12/10/2045	620	600,587	0.0
Series 2013-CR6, Class D	4.05%	03/10/2046	2,600	1,989,183	0.0
Series 2014-CR15, Class XA(i)	0.62%	02/10/2047	6,199	24,909	0.0
Series 2014-CR16, Class D	4.93%	04/10/2047	12,900	11,076,678	0.1
Series 2014-LC17, Class B	4.49%	10/10/2047	3,622	3,476,283	0.0
Series 2014-UBS6, Class AM	4.05%	12/10/2047	390	373,918	0.0
Series 2015-CR27, Class XA(i)	0.91%	10/10/2048	24,194	456,690	0.0
Series 2015-LC21, Class XA(i)	0.65%	07/10/2048	69,316	825,770	0.0
Series 2015-PC1, Class C	4.29%	07/10/2050	11,346	10,230,613	0.1
Series 2016-DC2, Class XA(i)	0.93%	02/10/2049	1,434	30,639	0.0
Series 2017-COR2, Class XA(i)	1.16%	09/10/2050	21,361	855,748	0.0
GS Mortgage Securities Trust Series 2011-GC5, Class D	5.15%	08/10/2044	3,699	1,534,143	0.0
Series 2013-GC13, Class D	4.08%	07/10/2046	17,538	7,725,401	0.1
Series 2014-GC22, Class C	4.69%	06/10/2047	993	877,339	0.0
Series 2016-GS3, Class XA(i)	1.20%	10/10/2049	112,528	3,675,033	0.0
Series 2017-GS5, Class XA(i)	0.83%	03/10/2050	130,902	3,451,360	0.0
Series 2017-GS7, Class XA(i)	1.08%	08/10/2050	80,615	2,959,940	0.0
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust Series 2013-C15, Class AS	4.42%	11/15/2045	11,115	10,956,679	0.1
Series 2014-C21, Class B	4.34%	08/15/2047	9,170	8,649,819	0.1
Series 2014-C22, Class XA(i)	0.80%	09/15/2047	52,565	431,015	0.0
Series 2014-C24, Class B	4.12%	11/15/2047	1,355	1,261,844	0.0
Series 2014-C24, Class C	4.38%	11/15/2047	455	386,084	0.0
Series 2014-C26, Class C	4.37%	01/15/2048	4,926	4,556,999	0.0
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2017-C5, Class XA(i)	0.89%	03/15/2050	129,313	3,345,856	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2012-C6, Class E	4.96%	05/15/2045	USD 5,000	\$ 3,947,132	0.0%
Series 2012-LC9, Class B(c)	3.81%	12/15/2047	178	174,833	0.0
Series 2012-LC9, Class E	3.78%	12/15/2047	10,881	8,957,236	0.1
Series 2013-C10, Class B	3.67%	12/15/2047	939	917,248	0.0
Series 2013-LC11, Class B	3.50%	04/15/2046	11,410	10,087,461	0.1
Series 2016-JP2, Class XA(i)	1.77%	08/15/2049	60,338	2,745,634	0.0
LCCM, Series 2017-LC26, Class XA(i)	1.52%	07/12/2050	32,869	1,610,530	0.0
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust					
Series 2013-C9, Class B	3.71%	05/15/2046	6,310	5,895,337	0.0
Series 2014-C19, Class D	3.25%	12/15/2047	4,304	3,303,037	0.0
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2011-C3, Class C	5.08%	07/15/2049	708	701,800	0.0
UBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2017-C1, Class XA(i)	1.52%	06/15/2050	46,475	2,258,025	0.0
Series 2017-C2, Class XA(i)	1.07%	08/15/2050	37,168	1,375,359	0.0
Series 2017-C4, Class XA(i)	1.09%	10/15/2050	54,512	2,108,215	0.0
Series 2017-C6, Class XA(i)	1.15%	12/15/2050	31,516	1,283,019	0.0
Series 2018-C10, Class XA(i)	0.87%	05/15/2051	123,705	4,484,252	0.0
Series 2018-C15, Class XA(i)	0.90%	12/15/2051	69,302	2,724,262	0.0
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust					
Series 2013-C5, Class C	3.91%	03/10/2046	1,798	1,294,506	0.0
Series 2013-C6, Class D	4.31%	04/10/2046	8,381	6,848,464	0.1
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-C28, Class B	4.08%	05/15/2048	2,802	2,633,019	0.0
Series 2015-LC20, Class C	4.06%	04/15/2050	7,415	6,774,299	0.1
Series 2015-LC20, Class XA(i)	1.29%	04/15/2050	31,465	599,779	0.0
Series 2015-SG1, Class AS	4.05%	09/15/2048	5,156	4,881,879	0.0
Series 2016-C32, Class XA(i)	1.21%	01/15/2059	108,678	3,060,882	0.0
Series 2016-LC24, Class XA(i)	1.61%	10/15/2049	77,734	3,380,582	0.0
Series 2016-LC25, Class XA(i)	0.83%	12/15/2059	120,496	3,080,234	0.0
Series 2017-C38, Class XA(i)	0.97%	07/15/2050	33,565	1,055,057	0.0
Series 2018-C48, Class XA(i)	1.06%	01/15/2052	11,613	473,186	0.0
WF-RBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2011-C4, Class E	4.85%	06/15/2044	8,030	6,429,010	0.0
Series 2012-C9, Class E	4.88%	11/15/2045	5,000	4,500,000	0.0
Series 2013-C11, Class B	3.71%	03/15/2045	1,144	1,098,139	0.0
Series 2014-C22, Class XA(i)	0.78%	09/15/2057	37,591	316,237	0.0
Series 2014-C24, Class AS	3.93%	11/15/2047	6,846	6,523,404	0.1
Series 2014-C25, Class D	3.80%	11/15/2047	9,035	7,433,939	0.1
Series 2014-LC14, Class C	4.34%	03/15/2047	853	810,053	0.0
				<u>259,201,051</u>	<u>1.4</u>
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS					
Morgan Stanley Capital I Trust,					
Series 2019-BPR, Class D(c)	8.84%	05/15/2036	9,789	8,879,941	0.1
Starwood Retail Property Trust,					
Series 2014-STAR, Class A(c)	6.06%	11/15/2027	36,183	24,966,365	0.1
				<u>33,846,306</u>	<u>0.2</u>
STAATLICHE CMBS					
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Multifamily Structured Pass-Through Certificates					
Series K072, Class A2	3.44%	12/25/2027	12,923	12,299,713	0.1
Series K073, Class A2	3.35%	01/25/2028	11,000	10,419,750	0.0
				<u>22,719,463</u>	<u>0.1</u>
				<u>315,766,820</u>	<u>1.7</u>
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAATSANLEIHEN					
BAHRAIN					
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	7.50%	10/25/2027	25,539	26,281,930	0.1
CHILE					
Corp. Nacional Del Cobre De Chi	5.13%	02/02/2033	2,373	2,298,547	0.0
INDONESIEN					
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.45%	05/15/2030	4,342	4,282,341	0.0
KASACHSTAN					
KazMunayGas National Co. JSC	4.75%	04/24/2025	1,395	1,353,848	0.0
KazMunayGas National Co. JSC	5.38%	04/24/2030	7,470	6,708,060	0.0
				<u>8,061,908</u>	<u>0.0</u>
MEXIKO					
Comision Federal de Electricidad	3.35%	02/09/2031	10,756	8,492,534	0.0
Comision Federal de Electricidad	3.88%	07/26/2033	10,400	7,873,450	0.0
Comision Federal de Electricidad	4.69%	05/15/2029	23,496	20,945,216	0.1
Comision Federal de Electricidad	6.13%	06/16/2045	5,200	4,464,850	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Petroleos Mexicanos	5.95%	01/28/2031	USD 71,699	\$ 54,638,223	0.3%
Petroleos Mexicanos	6.49%	01/23/2027	10,352	9,395,475	0.1
Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047	48,445	31,203,424	0.2
Petroleos Mexicanos	6.95%	01/28/2060	18,641	11,944,687	0.1
				<u>148,957,859</u>	<u>0.8</u>
PANAMA					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	4.00%	08/11/2041	9,964	8,066,481	0.1
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	5.13%	08/11/2061	8,472	6,644,166	0.0
				<u>14,710,647</u>	<u>0.1</u>
SÜDAFRIKA					
Transnet Soc Ltd.	8.25%	02/06/2028	17,800	17,844,500	0.1
TRINIDAD & TOBAGO					
Trinidad Generation UnLtd.	5.25%	11/04/2027	8,374	8,175,117	0.1
				<u>230,612,849</u>	<u>1.2</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Melco Resorts Finance Ltd.	5.38%	12/04/2029	12,622	10,413,150	0.1
Melco Resorts Finance Ltd.	5.63%	07/17/2027	9,002	7,948,766	0.0
MGM China Holdings Ltd.	5.25%	06/18/2025	8,970	8,421,709	0.1
MGM China Holdings Ltd.	5.38%	05/15/2024	4,527	4,397,698	0.0
MGM China Holdings Ltd.	5.88%	05/15/2026	4,869	4,518,432	0.0
Studio City Finance Ltd.	5.00%	01/15/2029	30,884	23,780,680	0.1
Wynn Macau Ltd.	4.88%	10/01/2024	953	910,115	0.0
Wynn Macau Ltd.	5.50%	01/15/2026	30,257	27,458,227	0.2
Wynn Macau Ltd.	5.50%	10/01/2027	4,203	3,635,595	0.0
Wynn Macau Ltd.	5.63%	08/26/2028	16,758	14,160,510	0.1
				<u>105,644,882</u>	<u>0.6</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	4.75%	05/09/2027	25,018	22,547,222	0.1
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	5.13%	05/09/2029	19,409	17,180,071	0.1
				<u>39,727,293</u>	<u>0.2</u>
ENERGIE					
Leviathan Bond Ltd.	5.75%	06/30/2023	16,779	16,663,644	0.1
Leviathan Bond Ltd.	6.13%	06/30/2025	5,318	5,147,496	0.0
Leviathan Bond Ltd.	6.50%	06/30/2027	12,964	12,306,817	0.1
				<u>34,117,957</u>	<u>0.2</u>
				<u>179,490,132</u>	<u>1.0</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 9 Ltd., Series 2020-9A, Class D(c)	8.51%	01/20/2034	4,250	4,106,516	0.0
AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class D(c)	7.69%	04/15/2034	6,750	6,199,220	0.0
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class D(c)	7.94%	04/15/2034	4,750	4,471,579	0.0
AIG CLO LLC, Series 2021-3A, Class D(c)	7.92%	01/25/2035	10,400	9,554,688	0.1
Apidos CLO XXIII, Series 2015-23A, Class ER(c)	10.99%	04/15/2033	2,248	2,000,063	0.0
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class D(c)	7.46%	04/20/2034	6,000	5,546,196	0.0
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2021-4A, Class D(c)	7.91%	10/20/2034	4,000	3,603,408	0.0
Ballyrock CLO 14 Ltd., Series 2020-14A, Class C(c)	8.41%	01/20/2034	8,330	7,825,843	0.1
Black Diamond CLO Ltd., Series 2016-1A, Class A2AR(c)	6.57%	04/26/2031	11,000	10,631,555	0.1
Black Diamond CLO Ltd., Series 2019-2A, Class B(c)	7.87%	07/23/2032	8,000	7,776,776	0.0
CIFC Funding Ltd., Series 2017-3A, Class A1(c)	6.03%	07/20/2030	536	533,630	0.0
Dryden 49 Senior Loan Fund, Series 2017-49A, Class E(c)	11.09%	07/18/2030	4,717	4,061,227	0.0
Elmwood CLO 15 Ltd., Series 2022-2A, Class D(c)	8.32%	04/22/2035	3,550	3,406,722	0.0
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class D(c)	7.84%	04/15/2034	8,000	7,489,424	0.0
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class DR(c)	7.56%	10/20/2030	6,000	5,561,274	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 Ltd., Series 2019-33A, Class DR(c)	7.69%	10/16/2033	1,875	1,759,384	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 Ltd., Series 2020-39A, Class D(c)	8.41%	01/20/2032	1,000	954,227	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 43 Ltd., Series 2021-43A, Class D(c)	7.89%	07/17/2035	11,050	10,372,778	0.1
New Mountain CLO 3 Ltd., Series CLO-3A, Class D(c)	8.16%	10/20/2034	11,950	10,749,431	0.1
OZLM VII Ltd., Series 2014-7RA, Class BR(c)	6.99%	07/17/2029	9,000	8,641,224	0.1
OZLM XVIII Ltd., Series 2018-18A, Class B(c)	6.38%	04/15/2031	3,000	2,882,340	0.0
Pikes Peak CLO 10, Series 2022-10A, Class D(c)	8.48%	04/22/2034	8,650	8,170,548	0.1
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class D(c)	7.91%	07/20/2034	4,000	3,677,068	0.0
THL Credit Wind River CLO Ltd., Series 2017-4A, Class A(c)	6.07%	11/20/2030	6,218	6,150,286	0.0
Venture XXVII CLO Ltd., Series 2017-27A, Class D(c)	8.81%	07/20/2030	17,169	15,028,879	0.1
Whehle Park CLO Ltd., Series 2022-1A, Class D(c)	8.00%	04/21/2035	7,000	6,452,607	0.0
				<u>157,606,893</u>	<u>0.8</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ABS-ANLEIHEN					
AUTOS – FESTVERZINSLICH					
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2019-2A, Class C	4.24%	09/22/2025	USD 4,000	\$ 3,846,707	0.0%
Exeter Automobile Receivables Trust, Series 2018-4A, Class E	5.38%	07/15/2025	13,125	13,093,296	0.1
Flagship Credit Auto Trust Series 2019-1, Class E	5.06%	06/15/2026	5,339	5,124,835	0.0
Series 2019-2, Class E	4.52%	12/15/2026	5,677	5,330,407	0.1
Series 2019-3, Class E	3.84%	12/15/2026	5,230	4,884,425	0.0
				<u>32,279,670</u>	<u>0.2</u>
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE					
BAHRAIN					
Bahrain Government International Bond	5.45%	09/16/2032	16,444	14,799,600	0.1
Bahrain Government International Bond	7.38%	05/14/2030	7,799	8,023,221	0.0
				<u>22,822,821</u>	<u>0.1</u>
ECUADOR					
Ecuador Government International Bond	2.50%	07/31/2035	3,678	1,284,672	0.0
				<u>1,284,672</u>	<u>0.0</u>
NIGERIA					
Nigeria Government International Bond	7.14%	02/23/2030	1,599	1,233,229	0.0
				<u>1,233,229</u>	<u>0.0</u>
				<u>25,340,722</u>	<u>0.1</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN					
VEREINIGTE STAATEN					
Wisconsin Public Finance Authority, Series 2021	5.75%	07/25/2041	15,000	13,385,157	0.1
				<u>18,152,736,078</u>	<u>98.2</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 12 Ltd. Series 2021-12A, Class D(c)	7.66%	07/20/2034	6,000	5,590,272	0.0
AGL CLO 13 Ltd. Series 2021-13A, Class D(c)	7.96%	10/20/2034	27,834	26,041,547	0.2
AGL CLO 16 Ltd. Series 2021-16A, Class D(c)	7.91%	01/20/2035	5,550	5,186,031	0.0
Ballyrock CLO 16 Ltd. Series 2021-16A, Class C(c)	7.71%	07/20/2034	3,000	2,730,126	0.0
Ballyrock CLO 17 Ltd. Series 2021-17A, Class C(c)	7.86%	10/20/2034	13,950	12,753,620	0.1
CBAM Ltd. Series 2018-7A, Class B1(c)	6.41%	07/20/2031	7,726	7,554,127	0.0
Dryden 57 CLO Ltd. Series 2018-57A, Class A(c)	5.87%	05/15/2031	25,195	24,919,316	0.1
Eaton Vance CLO Ltd. Series 2014-1RA, Class D(c)	7.84%	07/15/2030	1,500	1,398,665	0.0
Goldentree Loan Opportunities Ltd. Series 2015-11A, Class AR2(c)	5.86%	01/18/2031	600	595,891	0.0
Greywolf CLO VI Ltd. Series 2018-1A, Class A1(c)	5.96%	04/26/2031	22,100	21,912,150	0.1
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd. Series 2018-1A, Class A2(c)	6.61%	07/21/2031	7,424	7,179,754	0.0
ICG US CLO Ltd. Series 2015-1A, Class CR(c)	7.90%	10/19/2028	2,500	2,427,970	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 Ltd. Series 2019-33A, Class CR(c)	6.69%	10/16/2033	12,000	11,434,368	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 Ltd. Series 2021-42A, Class D(c)	7.59%	07/16/2035	4,000	3,697,176	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 51 Ltd. Series 2022-51A, Class D(c)	10.35%	10/23/2035	9,161	9,272,235	0.1
Northwoods Capital XII-B Ltd. Series 2018-12BA, Class B(c)	6.62%	06/15/2031	5,400	5,230,073	0.0
Octagon Investment Partners 35 Ltd. Series 2018-1A, Class D(c)	10.01%	01/20/2031	2,750	2,258,011	0.0
Octagon Investment Partners 38 Ltd. Series 2018-1A, Class B(c)	6.76%	07/20/2030	3,900	3,716,197	0.0
OZLM VII Ltd. Series 2014-7RA, Class CR(c)	7.79%	07/17/2029	10,500	9,715,944	0.1
OZLM XVIII Ltd. Series 2018-18A, Class A(c)	5.85%	04/15/2031	9,625	9,472,290	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Peace Park CLO Ltd. Series 2021-1A, Class D(c)	7.76%	10/20/2034	USD 27,675	\$ 25,521,747	0.1%
PPM CLO 5 Ltd. Series 2021-5A, Class D(c)	7.84%	10/18/2034	16,000	14,033,232	0.1
Signal Peak CLO 12 Ltd. Series 2022-12A, Class D(c)	9.45%	07/18/2034	4,550	4,435,490	0.0
Sound Point CLO XIX Ltd. Series 2018-1A, Class A(c)	5.79%	04/15/2031	34,104	33,604,069	0.2
TICP CLO IX Ltd. Series 2017-9A, Class B(c)	6.41%	01/20/2031	1,550	1,531,947	0.0
Venture XXIX CLO Ltd. Series 2017-29A, Class C(c)	7.36%	09/07/2030	2,300	2,184,374	0.0
Voya CLO Ltd. Series 2016-3A, Class A1R(c)	5.98%	10/18/2031	3,000	2,977,212	0.0
Voya CLO Ltd. Series 2016-3A, Class BR(c)	6.99%	10/18/2031	10,000	9,407,670	0.1
				<u>266,781,504</u>	<u>1.4</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
REITs					
Park Intermediate Holdings LLC/ PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer	4.88%	05/15/2029	13,793	11,537,869	0.1
INDUSTRIE					
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
National CineMedia LLC	5.75%	08/15/2026	8,693	167,769	0.0
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Royal Caribbean Cruises Ltd.	11.50%	06/01/2025	34,310	36,446,484	0.2
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Post Holdings, Inc.	4.50%	09/15/2031	8,368	7,068,472	0.1
Post Holdings, Inc.	4.63%	04/15/2030	5,000	4,336,435	0.0
				<u>11,404,907</u>	<u>0.1</u>
ENERGIE					
New Fortress Energy, Inc.	6.75%	09/15/2025	22,561	21,139,811	0.1
PDC Energy, Inc.	6.13%	09/15/2024	3,417	3,387,363	0.0
				<u>24,527,174</u>	<u>0.1</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
ION Trading Technologies SARL	5.75%	05/15/2028	11,107	9,069,448	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC	5.75%	11/01/2028	34,084	22,161,506	0.1
				<u>31,230,954</u>	<u>0.2</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.	8.00%	09/20/2025	26,356	26,459,746	0.1
				<u>130,237,034</u>	<u>0.7</u>
				<u>141,774,903</u>	<u>0.8</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
Grantor Trust CGCMT, Series 2015-P1X(j)	4.49%	09/15/2048	105	4,941,799	0.0
Grantor Trust COMM, Series 2014-UBS2(j)	0.00%	03/10/2047	143	4,675,194	0.0
Grantor Trust CSAIL, Series 2015-C1(j)	4.00%	04/15/2050	207	5,388,285	0.1
Grantor Trust JPMBB, Series 2014-C24(j)	4.00%	11/15/2047	222	2,733,268	0.0
Grantor Trust WFRBS, Series 2014-C23(j)	3.40%	10/15/2057	125	4,020,173	0.0
GS Mortgage Securities Trust Series 2013-GC13, Class E(j)	3.49%	07/10/2046	231	7,552,400	0.1
Series 2013-GC13, Class F(j)	3.49%	07/10/2046	80	2,498,510	0.0
				<u>31,809,629</u>	<u>0.2</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE					
PAKISTAN					
Pakistan Government International Bond	7.38%	04/08/2031	6,534	2,810,339	0.0
INDUSTRIE					
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
VTR Finance NV	6.38%	07/15/2028	3,891	1,671,184	0.0
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Tonon Luxembourg SA(g) (j)	6.50%	10/31/2024	4,600	460	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(f) (j)	10.50%	01/28/2018	3,700	370	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(f) (j)	11.75%	02/09/2022	31,238	3,124	0.0
				<u>3,954</u>	<u>0.0</u>
				<u>1,675,138</u>	<u>0.0</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Chile Electricity PEC SpA	0.00%	01/25/2028	USD 5,495	\$ 4,058,744	0.0%
Terraform Global Operating LP	6.13%	03/01/2026	7,314	<u>7,014,132</u>	<u>0.1</u>
				<u>11,072,876</u>	<u>0.1</u>
				<u>15,558,353</u>	<u>0.1</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN					
VEREINIGTE STAATEN					
State of California					
Series 2010	7.60%	11/01/2040	1,600	2,064,056	0.0
State of Illinois					
Series 2010	7.35%	07/01/2035	7,127	<u>7,754,212</u>	<u>0.1</u>
				<u>9,818,268</u>	<u>0.1</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
ABN AMRO Bank NV	7.75%	05/15/2023	7,651	<u>7,663,472</u>	<u>0.0</u>
INDUSTRIE					
TECHNOLOGIE					
NXP BV/NXP Funding LLC	5.55%	12/01/2028	1,500	<u>1,497,188</u>	<u>0.0</u>
				<u>9,160,660</u>	<u>0.0</u>
STAMMAKTIEN					
Mt Logan Re Ltd. (Special Investment) (j)			10,878	<u>7,669,274</u>	<u>0.0</u>
QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAATSANLEIHEN					
UKRAINE					
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC(g)	7.63%	11/08/2026	14,994	2,848,860	0.0
State Agency of Roads of Ukraine	6.25%	06/24/2030	22,184	<u>3,844,765</u>	<u>0.0</u>
				<u>6,693,625</u>	<u>0.0</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
JPMorgan Madison Avenue Securities Trust,					
Series 2015-CH1, Class M2(c)	10.12%	10/25/2025	419	410,737	0.0
Wells Fargo Credit Risk Transfer Securities Trust,					
Series 2015-WF1, Class 1M2(c)	9.87%	11/25/2025	499	<u>465,141</u>	<u>0.0</u>
				<u>875,878</u>	<u>0.0</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
INVESTITIONSGÜTER					
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	19,218	<u>57,653</u>	<u>0.0</u>
				<u>490,199,747</u>	<u>2.6</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$21,656,619,336)				<u>\$ 18,642,935,825</u>	<u>100.8%</u>
Termineinlagen					
ANZ, Hong Kong(k)	2.09 %	–		185,424	0.0
BBH, Grand Cayman(k)	4.10 %	–		5,223	0.0
BNP Paribas, Paris(k)	0.74 %	–		3,710,158	0.0
DBS Bank, Singapore(k)	3.93 %	–		148,220,434	0.8
HSBC Bank PLC, London(k)	2.92 %	–		92,719	0.0
HSBC, Singapore(k)	2.56 %	–		1,304	0.0
Scotiabank, Toronto(k)	3.33 %	–		9,466	0.0
SEB, Stockholm(k)	(0.56)%	–		57	0.0
SMBC, Tokyo(k)	1.53 %	–		10,367,115	0.1
Standard Chartered Bank, Johannesburg(k)	5.62 %	–		<u>298,408</u>	<u>0.0</u>
				<u>162,890,308</u>	<u>0.9</u>
Termineinlagen insgesamt					
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					
				<u>(318,363,777)</u>	<u>(1.7)</u>
Nettovermögen					
				<u>\$ 18,487,462,356</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Long					
U.S. 10 Yr Ultra Futures	03/22/2023	229	\$ 26,928,969	\$ 26,846,672	\$ (82,297)
U.S. Long Bond (CBT) Futures	06/21/2023	3,741	471,574,516	468,443,344	(3,131,172)
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	06/30/2023	7,465	1,524,242,703	1,520,818,785	(3,423,918)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	06/30/2023	4,807	518,142,023	514,611,885	(3,530,138)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	06/21/2023	3,910	437,431,250	436,575,938	(855,312)
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	06/21/2023	3,162	427,316,641	427,067,625	(249,016)
Short					
U.S. 10 Yr Ultra Future	06/21/2023	1,384	162,063,641	162,187,500	(123,859)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures+	06/21/2023	59	6,590,734	6,587,718	3,016
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	03/22/2023	597	80,251,875	80,333,813	(81,938)
					\$ (11,474,634)
				Wertsteigerung	\$ 3,016
				Wertminderung	\$ (11,477,650)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD	1,422,481	USD	957,395	03/02/2023	\$ 208,097
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD	322,298	USD	236,881	03/02/2023	678,540
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF	15,605	USD	16,629	03/02/2023	60,742
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	206,023	USD	217,584	03/02/2023	(326,397)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	298,605	USD	356,721	03/02/2023	(2,456,257)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY	1,900,463	USD	13,980	03/02/2023	21,757
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD	175,681	USD	108,302	03/02/2023	(321,595)
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN	60,647	USD	13,537	03/02/2023	(96,283)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD	409,706	USD	303,526	03/02/2023	(309,392)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	980,856	AUD	1,422,481	03/02/2023	(23,668,691)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	239,744	CAD	322,298	03/02/2023	(3,541,289)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	16,850	CNH	15,605	03/02/2023	(281,363)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	220,222	EUR	206,023	03/02/2023	(2,312,289)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	56,958	GBP	47,356	03/02/2023	3,150
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	302,587	GBP	251,250	03/02/2023	(370,763)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	14,161	JPY	1,900,463	03/02/2023	(202,547)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	109,542	NZD	175,681	03/02/2023	(918,223)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	13,611	PLN	60,647	03/02/2023	22,242
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	306,680	SGD	409,706	03/02/2023	(2,845,190)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	85,226	ZAR	1,548,906	03/02/2023	(885,443)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR	1,548,906	USD	83,904	03/02/2023	(435,640)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD	1,654,531	USD	1,140,615	03/08/2023	27,036,208
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD	283,109	USD	210,621	03/08/2023	3,132,821
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	20,879	USD	3,046	03/08/2023	41,016
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	255,532	USD	307,810	03/08/2023	413,231
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	53,261	USD	64,053	03/08/2023	(17,983)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	540,239	AUD	802,793	03/08/2023	79,031
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,140,362	AUD	1,654,154	03/08/2023	(27,037,000)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	312,420	CAD	421,620	03/08/2023	(3,417,991)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	670	CNH	4,663	03/08/2023	953
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	78,209	CNH	529,485	03/08/2023	(2,011,304)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	364,117	GBP	303,766	03/08/2023	1,304,735
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	189,348	GBP	157,051	03/08/2023	(420,815)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD	638,972	USD	440,698	03/17/2023	10,486,048
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD	137,325	USD	102,438	03/17/2023	1,784,351
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	13,950	USD	2,029	03/17/2023	20,692
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	111,568	USD	119,563	03/17/2023	1,446,264
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	183	USD	194	03/17/2023	(513)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	149,193	USD	179,820	03/17/2023	313,357
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	1,178	USD	1,415	03/17/2023	(2,066)
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN	203	USD	46	03/17/2023	38
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN	62,606	USD	14,049	03/17/2023	(9,574)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD	231,354	USD	173,430	03/17/2023	1,792,095
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD	54	USD	40	03/17/2023	(59)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	418,535	AUD	621,736	03/17/2023	72,563
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	440,445	AUD	638,595	03/17/2023	(10,486,853)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	201,966	CAD	272,739	03/17/2023	(2,059,487)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	670	CNH	4,663	03/17/2023	932

Gegenpartei		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausbungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	77,771	CNH	532,111	03/17/2023	\$ (1,149,741)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	113,293	EUR	107,296	03/17/2023	300,481
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	118,846	EUR	110,892	03/17/2023	(1,444,875)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	177,918	GBP	148,912	03/17/2023	1,249,970
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	179,474	GBP	148,901	03/17/2023	(319,547)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	27,585	PLN	123,253	03/17/2023	91,267
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	166,834	SGD	225,212	03/17/2023	247,004
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	173,636	SGD	231,632	03/17/2023	(1,793,038)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	28,885	ZAR	533,014	03/17/2023	99,629
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	31,764	ZAR	572,236	03/17/2023	(647,253)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR	571,065	USD	31,701	03/17/2023	647,468
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR	1,431	USD	78	03/17/2023	(262)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CAD	50,165	USD	37,022	03/24/2023	250,229
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CHF	15,883	USD	17,150	03/24/2023	243,588
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR	101,755	USD	108,439	03/24/2023	662,636
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR	183	USD	194	03/24/2023	(521)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	1,962,397	USD	14,622	03/24/2023	162,520
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	NZD	180,240	USD	112,387	03/24/2023	941,911
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD	188,681	USD	140,978	03/24/2023	972,510
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD	54	USD	40	03/24/2023	(61)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	73,030	CAD	99,154	03/24/2023	(348,368)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	33,780	CNH	31,488	03/24/2023	(261,878)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	104,945	EUR	99,346	03/24/2023	280,748
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	107,722	EUR	101,079	03/24/2023	(661,269)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	13,980	JPY	1,900,463	03/24/2023	23,637
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	14,622	JPY	1,962,397	03/24/2023	(162,520)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	109,161	NZD	177,074	03/24/2023	326,714
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	111,547	NZD	178,877	03/24/2023	(944,364)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	137,251	SGD	185,248	03/24/2023	207,520
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	141,184	SGD	188,958	03/24/2023	(973,440)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	55,048	ZAR	1,016,413	03/24/2023	186,538
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	56,941	ZAR	1,040,015	03/24/2023	(423,508)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR	1,038,844	USD	56,877	03/24/2023	423,713
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR	1,431	USD	78	03/24/2023	(250)
						<u>\$ (37,328,956)</u>
					Wertsteigerung	\$ 56,236,946
					Wertminderung	\$ (93,565,902)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Verkaufskontrakte					
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 2,047	\$ (319,993)	\$ (290,458)
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 39, 5 Year Index	12/20/2027	1,337,190	19,574,790	63,353,016
Goldman Sachs International/(INTRCONX)	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	1,699	(265,595)	(241,080)
Insgesamt				<u>\$ 18,989,202</u>	<u>\$ 62,821,478</u>
				Wertsteigerung	\$ 63,353,016
				Wertminderung	\$ (531,538)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	USD 453,010	04/20/2023	2.850%	3 Month LIBOR	\$ 1,227,268
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	USD 58,460	06/28/2026	1.460%	3 Month LIBOR	5,609,518
Insgesamt					<u>\$ 6,836,786</u>

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Kontrahent	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominalbetrag (000)	Markt- wert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Verkaufskontrakte						
Barclays Bank PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,412	\$ (1,351,403)	\$ (63,649)	\$ (1,287,754)
Barclays Bank PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 14,349	(2,795,166)	(206,728)	(2,588,438)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 205	(31,999)	114	(32,113)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 4,095	(639,987)	(74,835)	(565,152)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 4,095	(639,987)	(69,145)	(570,842)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 8,189	(1,279,974)	(154,440)	(1,125,534)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 1,110	(439,476)	(198,581)	(240,895)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 2,220	(879,223)	(400,443)	(478,780)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 2,220	(879,223)	(398,559)	(480,664)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 2,220	(879,223)	(390,405)	(488,818)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,412	(1,351,403)	(545,797)	(805,606)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,412	(1,351,403)	(480,469)	(870,934)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,185	(1,261,400)	(362,378)	(899,022)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 5,459	(2,162,245)	(994,939)	(1,167,306)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,412	(1,351,403)	(69,925)	(1,281,478)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,412	(1,351,403)	(69,925)	(1,281,478)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,412	(1,351,403)	(65,223)	(1,286,180)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,412	(1,351,403)	(63,687)	(1,287,716)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(1,628,103)	510,037
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(1,615,179)	497,113
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,870	(559,033)	(859,906)	300,873
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 9,584	(1,866,947)	(2,152,331)	285,384
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,870	(559,033)	(801,027)	241,994
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 7,188	(1,400,266)	(1,630,619)	230,353
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 7,188	(1,400,266)	(1,614,313)	214,047
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 3,833	(746,757)	(939,406)	192,649
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 148	(28,734)	(16,784)	(11,950)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 210	(40,921)	(23,812)	(17,109)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 179	(34,772)	(10,227)	(24,545)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 482	(93,918)	(59,058)	(34,860)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,148	(223,613)	(107,044)	(116,569)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,109	(216,122)	(64,554)	(151,568)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,870	(559,033)	(231,085)	(327,948)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,870	(559,033)	(162,683)	(396,350)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 3,444	(670,840)	(262,375)	(408,465)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 8,609	(1,677,100)	(1,137,110)	(539,990)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(541,841)	(576,225)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(540,471)	(577,595)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(533,970)	(584,096)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(530,371)	(587,695)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(456,767)	(661,299)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,561	(1,083,295)	(318,613)	(764,682)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(333,956)	(784,110)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(321,245)	(796,821)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 8,609	(1,677,100)	(736,215)	(940,885)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 8,609	(1,677,100)	(652,567)	(1,024,533)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 11,099	(2,162,005)	(891,729)	(1,270,276)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 10,072	(1,962,066)	(574,351)	(1,387,715)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 10,370	(2,020,010)	(603,359)	(1,416,651)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 17,219	(3,354,199)	(1,319,422)	(2,034,777)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 14,349	(2,795,166)	(252,333)	(2,542,833)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 1,014	(158,525)	(37,518)	(121,007)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 1,490	(232,955)	(57,030)	(175,925)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 1,828	(285,754)	(66,623)	(219,131)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 1,987	(310,586)	(74,970)	(235,616)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 2,029	(317,114)	(76,475)	(240,639)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 5,072	(792,752)	(187,622)	(605,130)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 4,136	(646,387)	(40,508)	(605,879)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,071	(1,216,263)	(270,099)	(946,164)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,412	(1,351,403)	(60,541)	(1,290,862)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 6,482	(2,567,666)	(591,565)	(1,976,101)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 6,824	(2,702,806)	(130,446)	(2,572,360)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,343	(261,628)	(15,941)	(245,687)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 1,024	(159,997)	568	(160,565)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 2,047	(319,994)	(74,373)	(245,621)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 2,047	(319,993)	(38,610)	(281,383)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 2,231	(883,547)	(406,891)	(476,656)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 29,000	(11,486,926)	(5,202,571)	(6,284,355)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 183	(35,555)	(17,488)	(18,067)

Kontrahent	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominalbetrag (000)	Markt- wert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,870	\$ (559,033)	\$ (373,680)	\$ (185,353)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,870	(559,033)	(360,565)	(198,468)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,343	(456,395)	(224,480)	(231,915)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,387	(465,004)	(154,573)	(310,431)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,462	(479,650)	(161,759)	(317,891)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(737,416)	(380,650)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 6,486	(1,263,415)	(643,664)	(619,751)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 7,907	(1,540,248)	(873,492)	(666,756)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(410,383)	(707,683)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 6,402	(1,247,091)	(424,490)	(822,601)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 11,150	(2,171,956)	(746,717)	(1,425,239)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 11,479	(2,236,133)	(678,012)	(1,558,121)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 2,047	(319,993)	(41,447)	(278,546)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 2,047	(319,994)	(20,692)	(299,302)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 2,047	(319,994)	(18,277)	(301,717)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 2,883	(450,679)	(107,754)	(342,925)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 3,392	(530,101)	(68,140)	(461,961)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 4,095	(639,987)	(161,408)	(478,579)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 4,095	(639,987)	(145,927)	(494,060)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 10,237	(1,599,967)	(346,214)	(1,253,753)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 255	(101,085)	(46,514)	(54,571)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 1,373	(543,805)	(248,651)	(295,154)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 2,215	(877,331)	(397,699)	(479,632)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 2,215	(877,331)	(396,115)	(481,216)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,412	(1,351,403)	(486,407)	(864,996)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,412	(1,351,403)	(483,455)	(867,948)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 4,776	(1,891,964)	(594,688)	(1,297,276)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 8,509	(3,370,399)	(1,509,058)	(1,861,341)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 8,856	(3,507,972)	(1,560,294)	(1,947,678)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,870	(559,033)	(404,826)	(154,207)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,009	(391,323)	(202,145)	(189,178)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,870	(559,033)	(355,198)	(203,835)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,870	(559,033)	(302,206)	(256,827)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 3,703	(721,376)	(453,619)	(267,757)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,870	(559,033)	(289,823)	(269,210)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,870	(559,033)	(289,475)	(269,558)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,870	(559,033)	(267,609)	(291,424)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(821,765)	(296,301)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,870	(559,033)	(253,019)	(306,014)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(809,652)	(308,414)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(807,773)	(310,293)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(802,982)	(315,084)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,870	(559,033)	(232,942)	(326,091)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 3,731	(726,743)	(377,223)	(349,520)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(653,784)	(464,282)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,066)	(549,683)	(568,383)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 7,387	(1,438,951)	(475,643)	(963,308)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 8,609	(1,677,100)	(488,994)	(1,188,106)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 17,219	(3,354,199)	(1,385,937)	(1,968,262)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 133	(20,821)	(5,106)	(15,715)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 4,095	(639,987)	(74,835)	(565,152)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 1,592	(630,565)	(182,301)	(448,264)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,412	(1,351,403)	(62,001)	(1,289,402)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,412	(1,351,403)	(58,980)	(1,292,423)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 3,412	(1,351,403)	(55,625)	(1,295,778)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 6,824	(2,702,806)	(127,175)	(2,575,631)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 6,824	(2,702,806)	(124,131)	(2,578,675)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 2,870	(559,033)	(373,680)	(185,353)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 4,419	(860,911)	(536,328)	(324,583)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 3,747	(729,986)	(238,499)	(491,487)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,067)	(82,414)	(1,035,653)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,740	(1,118,067)	(57,380)	(1,060,687)
Insgesamt				<u>\$(149,362,594)</u>	<u>\$ (58,505,268)</u>	<u>\$ (90,857,326)</u>
					Wertsteigerung	\$ 2,472,450
					Wertminderung	\$ (93,329,776)

INFLATIONS-SWAPS (VPI)

Gegenpartei	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Deutsche Bank AG	USD 65,000	01/15/2026	1.578%	CPI#	\$ 10,980,942
Swaps insgesamt					\$ (10,218,120)

Variabler Zinssatz auf Basis der gemäß Verbraucherpreisindex ermittelten Inflationsrate.

- (a) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (b) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 28. Februar 2023.
- (c) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 28. Februar 2023.
- (d) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für offene OTC-Derivate zu dienen.
- (e) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (f) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (g) Not leidend.
- (h) Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (i) Kredit, bei dem bis zur Endfälligkeit nur Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (j) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (k) Tagesgeld.

Währungskürzel:

- AUD – Australian Dollar
- CAD – Canadian Dollar
- CHF – Swiss Franc
- CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
- EUR – Euro
- GBP – Great British Pound
- JPY – Japanese Yen
- NZD – New Zealand Dollar
- PLN – Polish Zloty
- SGD – Singapore Dollar
- USD – United States Dollar
- ZAR – South African Rand

Glossar:

- CBT – Chicago Board of Trade
- CDX-CMBX.NA – North American Commercial Mortgage-Backed Index
- CDX-NAHY – North American High Yield Credit Default Swap Index
- CLO – Collateralized Loan Obligations
- CMBS – Commercial Mortgage-Backed Securities
- CME – Chicago Mercantile Exchange
- CPI – Consumer Price Index
- INTRCONX – Inter-Continental Exchange
- JSC – Joint Stock Company
- LIBOR – London Interbank Offered Rate
- REIT – Real Estate Investment Trust
- REMICs – Real Estate Mortgage Investment Conduits

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettovermögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
ADLER Group SA	3.25%	08/05/2025	EUR 6,100	€ 2,765,441	0.2%
Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy	3.63%	02/04/2028	4,149	3,529,887	0.3
Constellium SE	3.13%	07/15/2029	3,810	3,033,250	0.3
Fiber Bidco SpA	11.00%	10/25/2027	2,788	2,989,406	0.2
Guala Closures SpA	3.25%	06/15/2028	1,854	1,572,429	0.1
INEOS Quattro Finance 1 PLC	3.75%	07/15/2026	4,128	3,558,780	0.3
Italmatch Chemicals SpA	10.00%	02/06/2028	3,678	3,776,907	0.3
Kronos International, Inc.	3.75%	09/15/2025	2,080	1,877,806	0.2
Monitchem HoldCo 3 SA	5.25%	03/15/2025	2,636	2,595,449	0.2
Rimini Bidco SpA(a)	7.30%	12/14/2026	6,960	6,721,804	0.5
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	4.38%	11/01/2026	3,900	3,588,735	0.3
Solvay Finance SAC(A)(b)	5.87%	06/03/2024	1,914	1,921,625	0.2
Synthomer PLC	3.88%	07/01/2025	3,200	2,977,437	0.2
Vallourec SA	8.50%	06/30/2026	2,500	2,512,607	0.2
				<u>43,421,563</u>	<u>3.5</u>
INVESTITIONSGÜTER					
ARD Finance SA(c)	5.00%	06/30/2027	1,350	1,034,390	0.1
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/ Ardagh Metal Packaging Finance PLC	3.00%	09/01/2029	2,603	1,944,874	0.2
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	2.13%	08/15/2026	8,820	7,595,126	0.6
Ctec II GmbH	5.25%	02/15/2030	8,308	6,836,060	0.5
IMA Industria Macchine Automatiche SpA	3.75%	01/15/2028	3,600	3,133,432	0.3
Paprec Holding SA	4.00%	03/31/2025	4,884	4,695,995	0.4
PCF GmbH	4.75%	04/15/2026	5,410	4,673,336	0.4
Renk AG/Frankfurt am Main	5.75%	07/15/2025	10,278	10,097,945	0.8
Titan Holdings II BV	5.13%	07/15/2029	8,200	6,468,411	0.5
TK Elevator Holdco GmbH	6.63%	07/15/2028	1,765	1,515,794	0.1
TK Elevator Midco GmbH	4.38%	07/15/2027	1,868	1,689,526	0.1
Verde Bidco SpA	4.63%	10/01/2026	2,720	2,472,237	0.2
				<u>52,157,126</u>	<u>4.2</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Altice Finco SA	4.75%	01/15/2028	5,617	4,341,525	0.3
Banijay Group SAS	6.50%	03/01/2026	776	733,891	0.1
Summer BC Holdco A SARL	9.25%	10/31/2027	1,748	1,447,846	0.1
Summer BC Holdco B SARL	5.75%	10/31/2026	3,445	3,058,855	0.2
Summer BidCo BV(c)	9.00%	11/15/2025	3,071	2,398,910	0.2
Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC	4.88%	07/15/2028	GBP 7,199	6,870,332	0.6
Ziggo Bond Co. BV	3.38%	02/28/2030	EUR 5,350	4,061,238	0.3
				<u>22,912,597</u>	<u>1.8</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Altice France Holding SA	8.00%	05/15/2027	1,500	1,190,695	0.1
Altice France SA/France	5.88%	02/01/2027	2,325	2,062,279	0.2
eircom Finance DAC	3.50%	05/15/2026	2,730	2,557,227	0.2
Iliad Holading SASU	5.13%	10/15/2026	3,650	3,443,898	0.3
Lorca Telecom Bondco SA	4.00%	09/18/2027	775	698,679	0.1
Telecom Italia SpA/Milano	6.88%	02/15/2028	7,353	7,444,912	0.6
Telefonica Europe BV(b)	4.38%	12/14/2024	9,400	9,131,472	0.7
Telefonica Europe BV(b)	6.14%	02/03/2030	2,200	2,110,110	0.2
Telefonica Europe BV(b)	7.13%	08/23/2028	1,200	1,231,349	0.1
United Group BV	3.13%	02/15/2026	2,110	1,799,248	0.1
United Group BV	4.00%	11/15/2027	3,540	2,797,100	0.2
Vmed O2 UK Financing I PLC	4.00%	01/31/2029	GBP 8,900	8,246,395	0.7
Vodafone Group PLC	4.88%	10/03/2078	7,600	8,245,292	0.6
				<u>50,958,656</u>	<u>4.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Dana Financing Luxembourg SARL	3.00%	07/15/2029	EUR 3,060	2,435,776	0.2
Faurecia SE	7.25%	06/15/2026	1,180	1,212,797	0.1
Ford Motor Credit Co. LLC	4.54%	03/06/2025	GBP 4,420	4,819,218	0.4
Ford Motor Credit Co. LLC	4.87%	08/03/2027	EUR 1,293	1,264,188	0.1
Ford Motor Credit Co. LLC	6.86%	06/05/2026	GBP 3,376	3,837,649	0.3
Goodyear Europe BV	2.75%	08/15/2028	EUR 3,000	2,447,178	0.2
IHO Verwaltungs GmbH(c)	3.75%	09/15/2026	5,947	5,393,482	0.5
Jaguar Land Rover Automotive PLC	4.50%	07/15/2028	1,951	1,576,093	0.1
Schaeffler AG	3.38%	10/12/2028	2,700	2,387,617	0.2
ZF Finance GmbH	3.00%	09/21/2025	1,400	1,321,032	0.1
ZF Finance GmbH	5.75%	08/03/2026	300	302,963	0.0
				<u>26,997,993</u>	<u>2.2</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	7.63%	03/01/2026	EUR 2,610	€ 2,320,884	0.2%
CPUK Finance Ltd.	4.50%	08/28/2027	GBP 4,577	4,428,236	0.4
CPUK Finance Ltd.	4.88%	08/28/2025	3,550	3,848,375	0.3
Deuce Finco PLC(a)	6.80%	06/15/2027	EUR 5,630	5,303,956	0.4
Motion Bondco DAC	4.50%	11/15/2027	2,000	1,781,406	0.1
Pinnacle Bidco PLC.	6.38%	02/15/2025	GBP 2,400	2,559,215	0.2
				<u>20,242,072</u>	<u>1.6</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Accor SA(b)	2.63%	01/30/2025	EUR 5,300	4,804,892	0.4
Allwyn Entertainment Financing UK PLC(a)	6.78%	02/15/2028	6,142	6,098,878	0.5
Castle UK Finco PLC	7.00%	05/15/2029	GBP 1,870	1,672,619	0.1
Castle UK Finco PLC(a)	7.90%	05/15/2028	EUR 5,826	4,971,940	0.4
Cirsa Finance International SARL.	4.75%	05/22/2025	1,840	1,795,069	0.2
HT Troplast GmbH	9.25%	07/15/2025	1,600	1,557,885	0.1
LHMC Finco 2 SARL(c)	7.25%	10/02/2025	7,782	7,296,396	0.6
Maison Finco PLC.	6.00%	10/31/2027	GBP 6,013	5,428,599	0.4
NH Hotel Group SA.	4.00%	07/02/2026	EUR 6,421	6,083,996	0.5
				<u>39,710,274</u>	<u>3.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
Punch Finance PLC	6.13%	06/30/2026	GBP 2,800	2,824,901	0.2
Stonegate Pub Co. Financing 2019 PLC	8.00%	07/13/2025	4,430	4,717,485	0.4
				<u>7,542,386</u>	<u>0.6</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Afflelou SAS	4.25%	05/19/2026	EUR 1,500	1,393,580	0.1
Afflelou SAS(a)	10.70%	05/19/2027	2,590	2,454,590	0.2
B&M European Value Retail SA	3.63%	07/15/2025	GBP 1,389	1,501,666	0.1
B&M European Value Retail SA	4.00%	11/15/2028	1,324	1,304,382	0.1
BK LC Lux Finco1 SARL	5.25%	04/30/2029	EUR 7,510	6,686,051	0.6
Marks & Spencer PLC	4.50%	07/10/2027	GBP 5,100	5,206,368	0.4
Maxeda DIY Holding BV	5.88%	10/01/2026	EUR 3,290	2,504,424	0.2
Shiba Bidco SpA	4.50%	10/31/2028	7,529	6,384,323	0.5
				<u>27,435,384</u>	<u>2.2</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Bellis Acquisition Co. PLC	4.50%	02/16/2026	GBP 3,909	3,804,035	0.3
Cab Selas	3.38%	02/01/2028	EUR 2,850	2,303,497	0.2
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	3.50%	02/11/2027	7,328	6,489,818	0.5
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	4.38%	01/15/2028	2,446	2,166,712	0.2
Chrome Holdco SASU	5.00%	05/31/2029	5,920	4,496,085	0.4
Grifols Escrow Issuer SA.	3.88%	10/15/2028	9,737	8,267,745	0.7
Gruenthal GmbH	3.63%	11/15/2026	7,278	6,673,584	0.5
Nidda BondCo GmbH	7.25%	09/30/2025	3,860	3,749,552	0.3
Nidda Healthcare Holding GmbH	7.50%	08/21/2026	1,490	1,460,204	0.1
Nomad Foods Bondco PLC	2.50%	06/24/2028	2,820	2,401,264	0.2
Picard Bondco SA	5.38%	07/01/2027	4,423	3,742,147	0.3
Premier Foods Finance PLC	3.50%	10/15/2026	GBP 1,600	1,630,553	0.1
Primo Water Holdings, Inc.	3.88%	10/31/2028	EUR 2,770	2,447,997	0.2
Rossini SARL	6.75%	10/30/2025	2,410	2,423,378	0.2
Spectrum Brands, Inc.	4.00%	10/01/2026	2,050	1,948,913	0.1
				<u>54,005,484</u>	<u>4.3</u>
ENERGIE					
Cullinan Holdco Scsp(a)	7.08%	10/15/2026	4,535	4,356,193	0.4
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Multiversity SRL(a)	6.72%	10/30/2028	3,450	3,370,073	0.3
SIG PLC.	5.25%	11/30/2026	6,954	6,000,867	0.5
				<u>9,370,940</u>	<u>0.8</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./					
Atlas Luxco 4 SARL	4.88%	06/01/2028	GBP 3,214	2,958,700	0.2
APCOA Parking Holdings GmbH	4.63%	01/15/2027	EUR 6,715	5,764,948	0.5
Arena Luxembourg Finance SARL	1.88%	02/01/2028	2,000	1,600,610	0.1
Elior Group SA	3.75%	07/15/2026	2,972	2,489,705	0.2
La Financiere Atalian SASU	6.63%	05/15/2025	GBP 3,825	2,862,394	0.2
Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH	6.00%	07/30/2026	EUR 4,355	4,181,887	0.3
Verisure Holding AB	9.25%	10/15/2027	1,194	1,262,980	0.1
Verisure Midholding AB	5.25%	02/15/2029	2,343	1,879,047	0.2
Villa Dutch Bidco BV	9.00%	11/03/2029	2,000	1,896,097	0.2
				<u>24,896,368</u>	<u>2.0</u>
TECHNOLOGIE					
Boxer Parent Co., Inc.	6.50%	10/02/2025	4,756	4,735,314	0.4
Cedacri Mergeco SpA(a)	7.28%	05/15/2028	7,968	7,734,972	0.6

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
Centurion Bidco SpA	5.88%	09/30/2026	EUR 10,100	€ 9,061,750	0.7%
iliad SA	5.38%	06/14/2027	800	781,362	0.1
Infineon Technologies AG(b)	3.63%	01/01/2028	4,500	4,074,920	0.3
TeamSystem SpA	3.50%	02/15/2028	6,650	5,907,602	0.5
				<u>32,295,920</u>	<u>2.6</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Albion Financing 1 SARL/Aggreko Holdings, Inc.	5.25%	10/15/2026	2,648	2,421,432	0.2
Avis Budget Finance PLC	4.75%	01/30/2026	2,738	2,643,081	0.2
BCP V Modular Services Finance II PLC	6.13%	11/30/2028	GBP 4,720	4,616,916	0.4
BCP V Modular Services Finance PLC	6.75%	11/30/2029	EUR 3,954	3,171,716	0.2
Gatwick Airport Finance PLC	4.38%	04/07/2026	GBP 5,600	5,831,780	0.5
Kapla Holding SAS	3.38%	12/15/2026	EUR 6,422	5,713,109	0.5
Loxam SAS	3.75%	07/15/2026	3,237	2,971,989	0.2
Loxam SAS	6.00%	04/15/2025	2,300	2,193,426	0.2
				<u>29,563,449</u>	<u>2.4</u>
				<u>445,866,405</u>	<u>35.9</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Banco de Sabadell SA(b)	5.00%	05/19/2027	3,000	2,445,244	0.2
Banco de Sabadell SA, Series E	5.63%	05/06/2026	7,100	7,110,587	0.6
Banco Santander SA(b)	4.38%	01/14/2026	2,800	2,435,944	0.2
Bank of Ireland Group PLC(b)	7.50%	05/19/2025	2,854	2,814,357	0.2
Bankinter SA(b)	6.25%	01/17/2026	3,800	3,697,819	0.3
BPER Banca	6.13%	02/01/2028	1,485	1,483,429	0.1
CaixaBank SA(b)	6.75%	06/13/2024	11,600	11,459,137	0.9
Raiffeisen Bank International AG(b)	6.00%	06/15/2026	2,400	2,041,795	0.2
Virgin Money UK PLC(b)	8.25%	06/17/2027	GBP 2,753	2,870,095	0.2
				<u>36,358,407</u>	<u>2.9</u>
MAKLER					
Kane Bidco Ltd.	6.50%	02/15/2027	1,953	2,015,062	0.2
FINANZEN					
doValue SpA	3.38%	07/31/2026	EUR 1,020	936,851	0.1
doValue SpA	5.00%	08/04/2025	6,493	6,367,094	0.5
Encore Capital Group, Inc.	4.88%	10/15/2025	4,956	4,651,820	0.4
LeasePlan Corp. NV(b)	7.38%	05/29/2024	3,015	2,994,271	0.2
				<u>14,950,036</u>	<u>1.2</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
Intrum AB	4.88%	08/15/2025	6,383	6,006,057	0.5
Motion Finco SARL	7.00%	05/15/2025	6,300	6,396,904	0.5
				<u>12,402,961</u>	<u>1.0</u>
REITs					
ADLER Group SA	2.25%	01/14/2029	2,600	1,065,741	0.1
Aedas Homes Opco SLU	4.00%	08/15/2026	3,250	2,907,314	0.2
Emeria Sasu	7.75%	03/31/2028	2,500	2,394,293	0.2
Heimstaden Bostad AB(b)	2.63%	02/01/2027	2,118	1,337,425	0.1
Heimstaden Bostad AB(b)	3.00%	10/29/2027	2,100	1,357,048	0.1
Neinor Homes SA	4.50%	10/15/2026	3,180	2,945,543	0.3
Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA	5.25%	04/01/2026	3,250	3,067,482	0.3
Vivion Investments SARL	3.00%	08/08/2024	6,900	5,701,550	0.4
Vivion Investments SARL	3.50%	11/01/2025	1,600	1,216,830	0.1
				<u>21,993,226</u>	<u>1.8</u>
				<u>87,719,692</u>	<u>7.1</u>
VERSORGBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
EDP - Energias de Portugal SA	5.94%	04/23/2083	1,600	1,578,809	0.1
ERDGAS					
UGI International LLC	2.50%	12/01/2029	4,350	3,438,619	0.3
				<u>5,017,428</u>	<u>0.4</u>
				<u>538,603,525</u>	<u>43.4</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
ABN AMRO Bank NV	4.25%	02/21/2030	1,800	1,775,455	0.1
AIB Group PLC	4.63%	07/23/2029	2,718	2,651,839	0.2
Banco Santander SA	5.13%	01/25/2030	GBP 1,300	1,443,653	0.1
Bank of America Corp.	1.66%	04/25/2028	EUR 2,500	2,245,024	0.2
Bank of America Corp.	1.95%	10/27/2026	2,631	2,474,362	0.2
Banque Federative du Credit Mutuel SA	3.88%	06/16/2032	2,800	2,630,619	0.2

AB FCPI
European Income Portfolio

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
Barclays PLC	5.26%	01/29/2034	EUR 1,162	€ 1,169,548	0.1%
Barclays PLC	8.41%	11/14/2032	GBP 450	536,068	0.0
Barclays PLC(b)	8.88%	09/15/2027	1,372	1,571,765	0.1
CaixaBank SA	6.25%	02/23/2033	EUR 2,000	2,030,200	0.2
Citigroup, Inc.	1.25%	07/06/2026	2,660	2,481,378	0.2
Commerzbank AG	5.13%	01/18/2030	500	498,957	0.0
Commerzbank AG	6.50%	12/06/2032	4,300	4,299,501	0.3
Commerzbank AG	8.63%	02/28/2033	GBP 1,000	1,166,172	0.1
Cooperatieve Rabobank UA(b)	4.38%	06/29/2027	EUR 17,600	15,794,991	1.3
Credit Agricole SA	3.38%	07/28/2027	3,000	2,928,505	0.2
Credit Suisse Group AG	3.25%	04/02/2026	5,640	5,153,740	0.4
Credit Suisse Group AG	7.00%	09/30/2027	GBP 1,800	1,955,747	0.2
Credit Suisse Group AG	7.75%	03/01/2029	EUR 3,505	3,493,908	0.3
Deutsche Bank AG	2.63%	12/16/2024	GBP 2,700	2,891,808	0.2
Deutsche Bank AG	3.25%	05/24/2028	EUR 2,000	1,859,171	0.2
DNB Bank ASA	1.38%	12/02/2025	GBP 1,739	1,848,258	0.2
Erste Group Bank AG(b)	4.25%	10/15/2027	EUR 18,600	15,370,468	1.2
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	7.13%	08/07/2025	GBP 11,430	13,568,425	1.1
HSBC Holdings PLC(b)	4.75%	07/04/2029	EUR 15,365	13,292,552	1.1
HSBC Holdings PLC(b)	6.00%	09/29/2023	5,281	5,263,889	0.4
HSBC Holdings PLC	6.36%	11/16/2032	5,791	5,960,008	0.5
ING Groep NV	0.10%	09/03/2025	4,400	4,125,366	0.3
Ing Groep NV	4.13%	08/24/2033	4,400	4,152,881	0.3
Intesa Sanpaolo SpA	4.75%	09/06/2027	1,800	1,797,021	0.1
Intesa Sanpaolo SpA	5.00%	03/08/2028	1,867	1,856,007	0.2
JPMorgan Chase & Co.	1.64%	05/18/2028	2,300	2,062,601	0.2
KBC Group NV(b)	4.25%	10/24/2025	13,000	11,563,858	0.9
Lloyds Banking Group PLC	2.00%	04/12/2028	GBP 3,790	3,705,367	0.3
Lloyds Banking Group PLC	6.63%	06/02/2033	836	946,450	0.1
Morgan Stanley	2.10%	05/08/2026	EUR 3,420	3,263,448	0.3
Morgan Stanley	4.81%	10/25/2028	2,300	2,327,205	0.2
Nationwide Building Society	6.18%	12/07/2027	GBP 1,027	1,189,600	0.1
NatWest Group PLC	2.00%	03/04/2025	EUR 3,400	3,320,700	0.3
NatWest Group PLC	7.42%	06/06/2033	GBP 779	903,235	0.1
NatWest Markets PLC	6.38%	11/08/2027	2,475	2,919,115	0.2
Skandinaviska Enskilda Banken AB	0.75%	08/09/2027	EUR 3,784	3,277,858	0.3
Societe Generale SA	4.25%	11/16/2032	1,800	1,797,093	0.1
Swedbank AB	1.30%	02/17/2027	2,040	1,809,503	0.1
Swedbank AB	2.10%	05/25/2027	1,865	1,731,659	0.1
Swedbank AB	3.63%	08/23/2032	2,200	2,038,577	0.2
UBS Group AG	1.00%	03/21/2025	3,700	3,580,450	0.3
UBS Group AG	2.75%	06/15/2027	2,100	1,997,741	0.2
UniCredit SpA	4.80%	01/17/2029	2,150	2,145,289	0.2
				<u>178,867,035</u>	<u>14.4</u>
VERSICHERUNGEN					
Allianz SE	2.12%	07/08/2050	3,200	2,629,679	0.2
Allianz SE	4.25%	07/05/2052	11,600	10,804,274	0.9
ASR Nederland NV	3.38%	05/02/2049	13,599	11,809,621	0.9
Assicurazioni Generali SpA	5.80%	07/06/2032	3,000	3,139,907	0.3
CNP Assurances(b)	4.75%	06/27/2028	12,000	11,079,352	0.9
Credit Agricole Assurances SA(b)	4.25%	01/13/2025	1,900	1,841,945	0.1
Credit Agricole Assurances SA	4.75%	09/27/2048	5,200	5,046,564	0.4
Liberty Mutual Group, Inc.	3.63%	05/23/2059	5,023	4,699,975	0.4
Metropolitan Life Global Funding I	1.75%	05/25/2025	2,519	2,407,045	0.2
				<u>53,458,362</u>	<u>4.3</u>
REITs					
American Tower Corp.	0.45%	01/15/2027	2,300	1,975,256	0.2
Aroundtown SA	1.00%	01/07/2025	4,200	3,689,006	0.3
Digital Stout Holding LLC	3.75%	10/17/2030	GBP 3,250	3,191,113	0.3
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	2.55%	12/05/2023	2,410	2,603,692	0.2
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	3.33%	03/24/2025	EUR 2,120	1,854,253	0.1
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	1.13%	09/04/2026	1,570	1,221,770	0.1
Summit Properties Ltd.	2.00%	01/31/2025	3,052	2,702,773	0.2
				<u>17,237,863</u>	<u>1.4</u>
				<u>249,563,260</u>	<u>20.1</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Celanese US Holdings LLC	4.78%	07/19/2026	5,150	5,002,141	0.4
INEOS Finance PLC	6.63%	05/15/2028	4,937	4,882,614	0.4
				<u>9,884,755</u>	<u>0.8</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettovermögen %
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Pinewood Finance Co., Ltd.	3.63%	11/15/2027	GBP 6,560	€ 6,674,570	0.5%
Sky Ltd.	6.00%	05/21/2027	5,000	5,937,709	0.5
Time Warner Cable LLC	5.25%	07/15/2042	10,160	9,549,825	0.8
				<u>22,162,104</u>	<u>1.8</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
AT&T, Inc.	5.50%	03/15/2027	3,750	4,290,255	0.4
AT&T, Inc.	7.00%	04/30/2040	2,900	3,641,188	0.3
AT&T, Inc., Series B(b)	2.88%	03/02/2025	EUR 1,900	1,759,991	0.1
Orange SA	8.13%	11/20/2028	GBP 4,747	6,199,564	0.5
PPF Telecom Group BV	3.25%	09/29/2027	EUR 3,600	3,310,332	0.3
				<u>19,201,330</u>	<u>1.6</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
General Motors Financial Co., Inc.	0.65%	09/07/2028	2,300	1,849,583	0.1
General Motors Financial Co., Inc.	5.15%	08/15/2026	GBP 677	757,165	0.1
Toyota Motor Finance Netherlands BV	4.63%	06/08/2026	3,240	3,664,670	0.3
Volkswagen International Finance NV(b)	3.88%	06/14/2027	EUR 3,300	2,935,843	0.2
				<u>9,207,261</u>	<u>0.7</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
CPUK Finance Ltd.	7.24%	02/28/2024	GBP 2,477	2,831,229	0.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
HOCHTIEF AG	0.63%	04/26/2029	EUR 249	195,510	0.0
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
VF Corp.	4.25%	03/07/2029	1,066	1,055,505	0.1
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Anheuser-Busch InBev SA/NV	9.75%	07/30/2024	GBP 11,922	14,410,518	1.2
Boston Scientific Corp.	0.63%	12/01/2027	EUR 2,000	1,719,551	0.1
JAB Holdings BV	4.75%	06/29/2032	1,800	1,818,697	0.2
				<u>17,948,766</u>	<u>1.5</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Travis Perkins PLC	4.50%	09/07/2023	GBP 1,137	1,282,833	0.1
DIENSTLEISTUNGEN					
Booking Holdings, Inc.	4.50%	11/15/2031	EUR 1,741	1,765,351	0.1
				<u>85,534,644</u>	<u>6.9</u>
VERSORGBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
EDP Finance BV	8.63%	01/04/2024	GBP 1,246	1,457,636	0.1
Electricite de France SA(b)	4.00%	07/04/2024	EUR 8,300	7,956,124	0.6
Electricite de France SA	4.25%	01/25/2032	600	584,508	0.1
Enel SpA(b) (d)	5.46%	01/10/2024	7,010	7,040,492	0.6
Enel SpA(b)	6.38%	04/16/2028	226	225,763	0.0
Iberdrola Finanzas SA(b)	4.88%	04/25/2028	1,900	1,838,376	0.2
Iberdrola International BV, Series NC6(b)	1.45%	11/09/2026	2,100	1,799,445	0.1
Orsted AS(b)	5.25%	12/08/3022	414	411,076	0.0
Vattenfall AB	3.00%	03/19/2077	800	728,799	0.1
				<u>22,042,219</u>	<u>1.8</u>
SONSTIGE VERSORGBETRIEBE					
Suez Saca	1.88%	05/24/2027	2,000	1,832,903	0.1
Veolia Environnement SA, Series .(b)	2.50%	01/20/2029	1,300	1,066,235	0.1
				<u>2,899,138</u>	<u>0.2</u>
				<u>24,941,357</u>	<u>2.0</u>
				<u>360,039,261</u>	<u>29.0</u>
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
FRANKREICH					
French Republic Government Bond OAT	6.00%	10/25/2025	32,547	34,886,734	2.8
DEUTSCHLAND					
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	6.25%	01/04/2030	81,821	100,175,137	8.1
SPANIEN					
Spain Government Bond	4.20%	01/31/2037	3,202	3,327,125	0.3
Spain Government Bond	5.15%	10/31/2044	12,233	14,396,221	1.1
Spain Government Bond	5.75%	07/30/2032	19,153	22,522,219	1.8
Spain Government Bond	6.00%	01/31/2029	13,010	14,832,644	1.2
				<u>55,078,209</u>	<u>4.4</u>
				<u>190,140,080</u>	<u>15.3</u>
GEDECKTE ANLEIHEN					
ABN AMRO Bank NV	0.88%	01/14/2026	3,200	2,966,833	0.2
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	0.25%	03/17/2025	3,079	2,863,652	0.2
Bank of Montreal	1.00%	04/05/2026	3,615	3,324,710	0.3

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (EUR)	Nettovermögen %
BNP Paribas Home Loan SFH SA	3.00%	01/31/2030	EUR 2,000	€ 1,946,540	0.2%
Caisse Francaise de Financement Local	3.00%	10/02/2028	3,100	3,018,693	0.2
Caisse Francaise de Financement Local	3.13%	11/16/2027	3,100	3,048,349	0.2
Canadian Imperial Bank of Commerce	0.01%	10/07/2026	5,680	4,974,792	0.4
Cie de Financement Foncier SA	3.13%	05/18/2027	4,400	4,324,662	0.4
Cie de Financement Foncier SA	4.00%	10/24/2025	1,800	1,814,441	0.2
Commonwealth Bank of Australia	0.75%	02/28/2028	3,800	3,297,211	0.3
Danske Mortgage Bank PLC	0.01%	11/24/2026	500	439,439	0.0
Danske Mortgage Bank PLC	2.13%	09/16/2025	2,804	2,701,308	0.2
Erste Group Bank AG	0.63%	01/18/2027	3,400	3,040,289	0.2
Lloyds Bank PLC	3.25%	02/02/2026	933	920,813	0.1
National Australia Bank Ltd.	0.63%	03/16/2027	3,970	3,507,763	0.3
Nationwide Building Society	2.25%	06/25/2029	3,200	2,971,710	0.2
Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj.	2.63%	12/01/2025	3,324	3,240,909	0.3
Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj.	3.00%	02/20/2030	2,500	2,435,276	0.2
Royal Bank of Canada	0.63%	03/23/2026	9,000	8,189,891	0.7
				<u>59,027,281</u>	<u>4.8</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
Neuberger Berman Loan Advisers Euro					
CLO 3 DAC Series 2022-3A, Class A (a)	3.37%	10/25/2034	3,700,000	3,575,539	0.3
Neuberger Berman Loan Advisers Euro					
CLO 3 DAC Series 2022-3A, Class D (a)	5.65%	10/25/2034	12,400,000	10,854,712	0.9
Richmond Park CLO 1 DAC Series 1X,					
Class DRR (a)	5.34%	07/14/2031	2,300,000	2,158,532	0.1
				<u>16,588,783</u>	<u>1.3</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
RCS & RDS SA	3.25%	02/05/2028	2,700	2,281,163	0.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Allwyn International AS	3.88%	02/15/2027	4,755	4,392,431	0.4
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	6.00%	01/31/2025	6,247	6,337,972	0.5
				<u>13,011,566</u>	<u>1.1</u>
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN					
KANADA					
Export Development Canada	0.50%	02/25/2027	4,769	4,260,782	0.3
NIEDERLANDE					
BNG Bank NV	1.88%	07/13/2032	7,000	6,200,823	0.5
				<u>10,461,605</u>	<u>0.8</u>
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
DEUTSCHLAND					
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	2.88%	12/28/2029	7,394	7,273,181	0.6
				<u>1,195,145,282</u>	<u>96.3</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
STAMMAKTEN					
K201640219 South Africa Ltd.(e)			18,655	18	0.0
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Hellas Telecommunications/Luxembourg III(e)	8.50%	10/15/2049	641	0	0.0
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Standard Industries, Inc./NJ	2.25%	11/21/2026	1,900	1,653,067	0.1
				<u>1,653,067</u>	<u>0.1</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
K201640219 South Africa Ltd. (e)	0.00%	06/25/2023	ZAR 84	0	0.0
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
NIEDERLANDE					
SNS Reaal NV (b) (e)	0.00%	12/31/2099	EUR 770,000	1	0.0
				<u>1,653,086</u>	<u>0.1</u>

	Zinssatz	Datum	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
Gesamtanlagen				
(Kosten €1,352,037,458)			€ 1,196,798,368	96,4%
Termineinlagen				
ANZ, London(f)	2.09 %	–	18,423	0.0
Citibank, New York(f)	3.93 %	–	936,244	0.1
HSBC, Hong Kong(f)	0.74 %	–	2,258	0.0
HSBC, Singapur(f)	2.56 %	–	35	0.0
SEB, Stockholm(f)	1.60 %	–	126	0.0
SEB, Stockholm(f)	2.92 %	–	197,687	0.0
SMBC, Tokyo(f)	1.53 %	–	19,699,459	1.6
Termineinlagen insgesamt			20,854,232	1.7
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			24,108,128	1.9
Nettovermögen			€ 1,241,760,728	100,0%

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
Euro Buxl 30 Yr Bond Futures	03/08/2023	479	€ 77,284,880	€ 64,320,120	€ (12,964,760)
Euro-BTP Futures	03/08/2023	667	75,406,770	75,164,230	(242,540)
Euro-Bund Futures	03/08/2023	1,084	146,906,540	144,074,440	(2,832,100)
Short					
Euro-BOBL Futures	03/08/2023	660	78,882,800	76,018,800	2,864,000
Euro-Schatz Futures	03/08/2023	828	88,362,600	86,923,440	1,439,160
Long Gilt Futures	06/28/2023	411	47,044,271	46,721,525	322,746
					€ (11,413,494)
				Wertsteigerung	€ 4,625,906
				Wertminderung	€ (16,039,400)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA	GBP 71,323	EUR 80,558	03/24/2023	€ (473,634)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP 2,653	EUR 3,000	03/24/2023	(14,783)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 235	EUR 32	03/08/2023	103
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2,672	CNH 19,538	03/08/2023	(21,673)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 10,929	HKD 92,204	03/08/2023	176,908
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 0*	USD 0*	03/08/2023	(1)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 266,085	USD 286,600	03/08/2023	4,781,296
Brown Brothers Harriman & Co.+	HKD 3,057	EUR 364	03/08/2023	(3,976)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 122	EUR 115	03/08/2023	303
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 5,667	EUR 5,302	03/08/2023	(53,212)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 221	EUR 30	03/17/2023	88
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2,808	CNH 20,627	03/17/2023	(10,032)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 20,756	HKD 174,337	03/17/2023	239,615
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 45	PLN 216	03/17/2023	595
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 4,830	SGD 6,903	03/17/2023	7,665
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 3	SGD 4	03/17/2023	(4)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 257,293	USD 275,795	03/17/2023	3,210,471
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 0*	USD 0*	03/17/2023	(1)
Brown Brothers Harriman & Co.+	HKD 1,643	EUR 196	03/17/2023	(1,612)
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 3	EUR 1	03/17/2023	(8)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 40	EUR 28	03/17/2023	85
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 47	EUR 33	03/17/2023	(23)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 122	EUR 115	03/17/2023	305
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 4,018	EUR 3,765	03/17/2023	(30,819)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 1,898	EUR 1,215	03/24/2023	8,823
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF 25	EUR 26	03/24/2023	212
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 199	AUD 313	03/24/2023	293
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 86,393	AUD 134,993	03/24/2023	(557,945)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2,314	CHF 2,284	03/24/2023	(18,758)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 618	SGD 882	03/24/2023	(376)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 236,798	USD 252,374	03/24/2023	1,475,315
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 0*	USD 0*	03/24/2023	(1)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 40	EUR 28	03/24/2023	85

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 122	EUR 115	03/24/2023	€ 309
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 1,059	EUR 996	03/24/2023	(4,267)
Royal Bank of Scotland PLC.....	GBP 98,035	EUR 111,265	04/17/2023	(8,967)
				<u>€ 8,702,379</u>
			Wertsteigerung	€ 9,902,471
			Wertminderung	€ (1,200,092)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Verkaufskontrakte Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	iTraxx-XOVER Series 38, 5 Year Index	12/20/2027	EUR 47,520	€ (1,576,712)	€ (88,755)

* Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

- (a) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 28. Februar 2023.
- (b) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (c) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (d) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 28. Februar 2023.
- (e) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (f) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD	- Australian Dollar
CHF	- Swiss Franc
CNH	- Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
EUR	- Euro
GBP	- Great British Pound
HKD	- Hong Kong Dollar
PLN	- Polish Zloty
SGD	- Singapore Dollar
USD	- United States Dollar
ZAR	- South African Rand

Glossar:

BOBL	- Bundesobligationen
BTP	- Buoni del Tesoro Poliennali
CLO	- Collateralized Loan Obligations
INTRCONX	- Inter-Continental Exchange
OAT	- Obligations Assimilables du Trésor

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
STAATSANLEIHEN					
Abu Dhabi Government International Bond	3.13%	10/11/2027	USD 3,175	\$ 2,990,453	0.6%
Abu Dhabi Government International Bond	3.13%	09/30/2049	4,290	3,088,800	0.6
Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029	1,106	1,000,930	0.2
Angolan Government International Bond	8.25%	05/09/2028	2,208	2,039,640	0.4
Angolan Government International Bond	9.13%	11/26/2049	7,714	6,537,615	1.3
Angolan Government International Bond	9.38%	05/08/2048	479	409,545	0.1
Argentine Republic Government International Bond	0.50%	07/09/2030	9,920	3,213,996	0.7
Argentine Republic Government International Bond	1.00%	07/09/2029	3,315	1,027,635	0.2
Argentine Republic Government International Bond	1.50%	07/09/2035	7,646	2,175,422	0.4
Argentine Republic Government International Bond	3.50%	07/09/2041	2,951	926,532	0.2
Argentine Republic Government International Bond	3.88%	01/09/2038	4,508	1,571,496	0.3
Bahrain Government International Bond	6.00%	09/19/2044	1,100	873,125	0.2
Bahrain Government International Bond	6.75%	09/20/2029	3,508	3,494,845	0.7
Brazilian Government International Bond	3.88%	06/12/2030	815	701,308	0.1
Chile Government International Bond	2.45%	01/31/2031	825	686,194	0.1
Chile Government International Bond	2.75%	01/31/2027	2,320	2,123,235	0.4
Chile Government International Bond	3.10%	05/07/2041	473	343,309	0.1
Chile Government International Bond	3.10%	01/22/2061	5,189	3,205,180	0.7
Colombia Government International Bond	3.25%	04/22/2032	4,354	3,078,278	0.6
Colombia Government International Bond	3.88%	02/15/2061	1,006	544,686	0.1
Colombia Government International Bond	4.13%	02/22/2042	4,097	2,499,170	0.5
Colombia Government International Bond	5.00%	06/15/2045	1,875	1,230,820	0.3
Colombia Government International Bond	5.63%	02/26/2044	200	143,300	0.0
Colombia Government International Bond	6.13%	01/18/2041	2,985	2,329,792	0.5
Colombia Government International Bond	7.50%	02/02/2034	3,640	3,443,440	0.7
Dominican Republic International Bond	4.88%	09/23/2032	335	279,893	0.1
Dominican Republic International Bond	5.50%	02/22/2029	1,750	1,619,078	0.3
Dominican Republic International Bond	5.88%	01/30/2060	3,855	2,877,517	0.6
Dominican Republic International Bond	5.95%	01/25/2027	770	753,301	0.2
Dominican Republic International Bond	6.50%	02/15/2048	2,724	2,303,142	0.5
Dominican Republic International Bond	6.85%	01/27/2045	2,236	1,986,965	0.4
Dominican Republic International Bond	8.63%	04/20/2027	742	772,051	0.2
Ecuador Government International Bond	1.50%	07/31/2040	3,722	1,154,581	0.2
Ecuador Government International Bond	2.50%	07/31/2035	15,544	5,428,810	1.1
Ecuador Government International Bond	5.50%	07/31/2030	4,630	2,234,773	0.4
Egypt Government International Bond	3.88%	02/16/2026	1,739	1,382,505	0.3
Egypt Government International Bond	5.25%	10/06/2025	1,007	866,020	0.2
Egypt Government International Bond	5.63%	04/16/2030	EUR 2,466	1,747,553	0.4
Egypt Government International Bond	6.38%	04/11/2031	863	611,573	0.1
Egypt Government International Bond	6.59%	02/21/2028	USD 3,878	3,015,145	0.6
Egypt Government International Bond	7.05%	01/15/2032	3,656	2,550,745	0.5
Egypt Government International Bond	7.30%	09/30/2033	824	556,200	0.1
Egypt Government International Bond	7.50%	02/16/2061	511	300,213	0.1
Egypt Government International Bond	7.90%	02/21/2048	4,692	2,815,200	0.6
Egypt Government International Bond	8.75%	09/30/2051	587	375,680	0.1
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	3,006	1,583,410	0.3
El Salvador Government International Bond	7.63%	02/01/2041	1,755	794,467	0.2
El Salvador Government International Bond	7.65%	06/15/2035	506	233,646	0.0
El Salvador Government International Bond	8.63%	02/28/2029	1,734	863,532	0.2
El Salvador Government International Bond	9.50%	07/15/2052	2,565	1,291,798	0.3
Gabon Government International Bond	6.63%	02/06/2031	660	534,311	0.1
Gabon Government International Bond	6.95%	06/16/2025	3,807	3,649,961	0.7
Ghana Government International Bond(a)	7.63%	05/16/2029	2,108	790,500	0.2
Ghana Government International Bond(a)	7.88%	02/11/2035	906	339,750	0.1
Ghana Government International Bond(a)	8.95%	03/26/2051	427	156,389	0.0
Guatemala Government Bond	4.38%	06/05/2027	6,687	6,318,379	1.3
Guatemala Government Bond	4.90%	06/01/2030	3,220	3,011,304	0.6
Hungary Government International Bond	2.13%	09/22/2031	7,279	5,550,237	1.1
Hungary Government International Bond	5.25%	06/16/2029	1,649	1,605,714	0.3
Hungary Government International Bond	5.50%	06/16/2034	2,987	2,856,319	0.6
Hungary Government International Bond	6.75%	09/25/2052	1,281	1,313,025	0.3
Indonesia Government International Bond	1.85%	03/12/2031	7,307	5,819,003	1.2
Indonesia Government International Bond	3.55%	03/31/2032	924	830,547	0.2
Indonesia Government International Bond	4.30%	03/31/2052	403	341,587	0.1
Israel Government International Bond	4.50%	01/17/2033	3,750	3,620,186	0.7
Ivory Coast Government International Bond	4.88%	01/30/2032	EUR 640	514,465	0.1
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	USD 4,045	3,822,525	0.8
Ivory Coast Government International Bond	6.63%	03/22/2048	EUR 730	534,694	0.1
Jamaica Government International Bond	7.88%	07/28/2045	USD 1,132	1,318,638	0.3
Kazakhstan Government International Bond	6.50%	07/21/2045	3,280	3,465,115	0.7
Lebanon Government International Bond(b)	6.00%	01/27/2023	1,360	92,905	0.0
Lebanon Government International Bond(b)	6.10%	10/04/2022	6,321	426,668	0.1
Lebanon Government International Bond(a)	6.20%	02/26/2025	4,428	298,890	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Lebanon Government International Bond(a)	1.00%	11/27/2026	USD 1,719	\$ 116,033	0.0%
Lebanon Government International Bond(a)	6.65%	04/22/2024	3,748	256,035	0.1
Lebanon Government International Bond(a)	6.65%	03/23/2027	4,936	333,180	0.1
Mexico Government International Bond	3.77%	05/24/2061	9,165	6,016,250	1.2
Mexico Government International Bond	5.40%	02/09/2028	878	878,439	0.2
Morocco Government International Bond	2.38%	12/15/2027	2,334	1,983,900	0.4
Nigeria Government International Bond	6.13%	09/28/2028	1,815	1,436,119	0.3
Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027	746	615,450	0.1
Nigeria Government International Bond	7.14%	02/23/2030	2,389	1,842,516	0.4
Nigeria Government International Bond	7.38%	09/28/2033	3,757	2,723,825	0.6
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047	5,087	3,395,572	0.7
Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	2,523	1,753,170	0.4
Nigeria Government International Bond	8.25%	09/28/2051	3,402	2,347,380	0.5
Nigeria Government International Bond	8.38%	03/24/2029	1,168	984,040	0.2
Oman Government International Bond	4.88%	02/01/2025	1,567	1,540,851	0.3
Oman Government International Bond	5.63%	01/17/2028	1,611	1,576,565	0.3
Oman Government International Bond	6.25%	01/25/2031	462	465,696	0.1
Oman Government International Bond	6.50%	03/08/2047	519	483,968	0.1
Oman Government International Bond	6.75%	01/17/2048	1,357	1,301,024	0.3
Pakistan Government International Bond	6.88%	12/05/2027	1,957	861,295	0.2
Panama Bonos del Tesoro, Series DOM	3.36%	06/30/2031	1,423	1,169,973	0.2
Panama Government International Bond	2.25%	09/29/2032	635	471,408	0.1
Panama Government International Bond	3.87%	07/23/2060	3,435	2,187,236	0.4
Panama Government International Bond	6.40%	02/14/2035	903	928,002	0.2
Panama Notas del Tesoro	3.75%	04/17/2026	2,612	2,453,321	0.5
Paraguay Government International Bond	3.85%	06/28/2033	1,929	1,624,941	0.3
Paraguay Government International Bond	4.70%	03/27/2027	617	592,050	0.1
Paraguay Government International Bond	4.95%	04/28/2031	2,475	2,323,097	0.5
Paraguay Government International Bond	5.00%	04/15/2026	1,601	1,560,275	0.3
Peruvian Government International Bond	2.78%	12/01/2060	4,784	2,748,707	0.6
Peruvian Government International Bond	3.23%	07/28/2121	1,977	1,145,177	0.2
Peruvian Government International Bond	5.63%	11/18/2050	2,890	2,825,517	0.6
Philippine Government International Bond	3.00%	02/01/2028	1,805	1,658,542	0.3
Philippine Government International Bond	3.20%	07/06/2046	3,307	2,364,869	0.5
Philippine Government International Bond	3.23%	03/29/2027	409	382,460	0.1
Philippine Government International Bond	3.56%	09/29/2032	2,722	2,409,269	0.5
Philippine Government International Bond	3.75%	01/14/2029	745	698,519	0.1
Philippine Government International Bond	4.20%	03/29/2047	8,154	6,917,140	1.4
Philippine Government International Bond	5.50%	03/30/2026	918	931,871	0.2
Qatar Government International Bond	4.40%	04/16/2050	6,920	6,210,700	1.3
Qatar Government International Bond	5.10%	04/23/2048	3,138	3,090,930	0.6
Republic of Azerbaijan International Bond	3.50%	09/01/2032	3,090	2,599,076	0.5
Republic of Kenya Government International Bond	7.25%	02/28/2028	833	719,504	0.1
Republic of Poland Government International Bond	5.50%	11/16/2027	2,093	2,133,646	0.4
Republic of South Africa Government International Bond	4.85%	09/30/2029	2,457	2,159,089	0.4
Republic of South Africa Government International Bond	5.38%	07/24/2044	1,602	1,181,475	0.2
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	5,128	3,724,210	0.8
Republic of South Africa Government International Bond	5.88%	04/20/2032	1,220	1,084,275	0.2
Romanian Government International Bond	3.00%	02/14/2031	1,528	1,233,860	0.3
Romanian Government International Bond	3.63%	03/27/2032	2,928	2,408,280	0.5
Romanian Government International Bond	4.00%	02/14/2051	2,100	1,459,500	0.3
Romanian Government International Bond	5.25%	11/25/2027	3,118	3,012,767	0.6
Romanian Government International Bond	6.00%	05/25/2034	1,076	1,043,720	0.2
Saudi Government International Bond	3.45%	02/02/2061	3,345	2,302,405	0.5
Saudi Government International Bond	5.00%	04/17/2049	1,617	1,485,619	0.3
Saudi Government International Bond	5.25%	01/16/2050	2,098	2,003,590	0.4
Senegal Government International Bond	4.75%	03/13/2028	EUR 789	709,346	0.1
Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	USD 1,670	1,375,662	0.3
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	3,638	2,551,147	0.5
Serbia International Bond	6.50%	09/26/2033	729	708,953	0.1
Sharjah Sukuk Ltd.	3.76%	09/17/2024	796	776,000	0.2
Sri Lanka Government International Bond(a)	6.20%	05/11/2027	1,769	638,277	0.1
Sri Lanka Government International Bond(a)	6.85%	11/03/2025	5,158	1,928,770	0.4
Sri Lanka Government International Bond(a)	7.55%	03/28/2030	273	98,587	0.0
Sri Lanka Government International Bond(a)	7.85%	03/14/2029	2,614	947,863	0.2
Turkey Government International Bond	4.88%	04/16/2043	3,390	2,139,937	0.4
Turkey Government International Bond	5.75%	05/11/2047	3,766	2,518,512	0.5
Turkey Government International Bond	6.63%	02/17/2045	1,085	815,106	0.2
Ukraine Government International Bond	6.88%	05/21/2031	792	133,452	0.0
Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2034	1,405	240,958	0.1
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2026	5,724	1,045,703	0.2
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2028	7,740	1,445,445	0.3
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2029	1,434	268,248	0.1
Ukraine Government International Bond	8.99%	02/01/2026	1,750	325,719	0.1
Uruguay Government International Bond	4.98%	04/20/2055	1,478	1,414,374	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Uruguay Government International Bond	5.10%	06/18/2050	USD 1,379	\$ 1,349,775	0.3%
Venezuela Government International Bond(b)	7.75%	10/13/2019	2,834	276,296	0.1
Venezuela Government International Bond(a)	9.00%	05/07/2023	5,842	569,634	0.1
Venezuela Government International Bond(a)	9.25%	09/15/2027	4,619	450,353	0.1
Venezuela Government International Bond(a)	9.25%	05/07/2028	8,171	796,692	0.2
Venezuela Government International Bond(a)	11.95%	08/05/2031	762	74,266	0.0
Venezuela Government International Bond(b)	12.75%	08/23/2022	2,087	203,522	0.0
Zambia Government International Bond(a)	8.97%	07/30/2027	2,380	1,059,100	0.2
				<u>264,305,681</u>	<u>54.0</u>
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	5.13%	08/11/2061	1,928	1,512,034	0.3
Comision Federal de Electricidad	4.68%	02/09/2051	1,193	788,722	0.2
Comision Federal de Electricidad	4.69%	05/15/2029	1,189	1,059,919	0.2
Comision Federal de Electricidad	5.00%	09/29/2036	1,720	1,376,320	0.3
Corp. Nacional Del Cobre De Chi	5.13%	02/02/2033	565	547,273	0.1
Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.00%	09/30/2029	4,285	3,718,041	0.8
Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.15%	01/14/2030	439	381,601	0.1
DP World Ltd./United Arab Emirates	5.63%	09/25/2048	2,150	2,066,419	0.4
DP World Salaam(c)	6.00%	10/01/2025	4,706	4,676,587	1.0
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	4.70%	05/07/2050	1,375	1,169,438	0.2
Eskom Holdings SOC Ltd.	6.75%	08/06/2023	1,300	1,286,350	0.3
Eskom Holdings SOC Ltd.	7.13%	02/11/2025	1,115	1,095,042	0.2
Export-Import Bank of China (The)	4.00%	11/28/2047	5,917	5,117,465	1.0
Gacsi First Investment Co.	4.75%	02/14/2030	3,457	3,379,720	0.7
Gacsi First Investment Co.	4.88%	02/14/2035	1,977	1,879,141	0.4
Gacsi First Investment Co.	5.00%	10/13/2027	1,820	1,802,630	0.4
Gacsi First Investment Co.	5.25%	10/13/2032	2,755	2,756,421	0.6
KazMunayGas National Co. JSC	4.75%	04/19/2027	5,950	5,444,250	1.1
KazMunayGas National Co. JSC	5.75%	04/19/2047	1,546	1,233,708	0.3
KazMunayGas National Co. JSC	6.38%	10/24/2048	1,190	996,625	0.2
Lamar Funding Ltd.	3.96%	05/07/2025	4,303	4,067,142	0.8
MDGH GMTN RSC Ltd.	3.00%	03/28/2027	2,245	2,063,716	0.4
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	7.50%	10/25/2027	3,192	3,284,855	0.7
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	7.63%	11/07/2024	2,935	2,986,362	0.6
Pertamina Persero PT	2.30%	02/09/2031	6,250	5,000,687	1.0
Pertamina Persero PT	6.00%	05/03/2042	1,174	1,134,554	0.2
Petroleos de Venezuela SA(a)	5.38%	04/12/2027	7,377	331,979	0.1
Petroleos de Venezuela SA(a)	5.50%	04/12/2037	8,347	375,615	0.1
Petroleos de Venezuela SA(b)	9.00%	11/17/2021	9,326	442,989	0.1
Petroleos Mexicanos	6.50%	03/13/2027	3,295	2,983,293	0.6
Petroleos Mexicanos	6.70%	02/16/2032	5,190	4,108,404	0.8
Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047	4,008	2,581,553	0.5
Petroleos Mexicanos	6.88%	08/04/2026	2,713	2,591,322	0.5
Petroleos Mexicanos	6.95%	01/28/2060	1,675	1,073,298	0.2
Petroleos Mexicanos	7.69%	01/23/2050	3,114	2,187,429	0.4
Petronas Energy Canada Ltd.	2.11%	03/23/2028	2,165	1,896,945	0.4
QatarEnergy	3.30%	07/12/2051	8,127	5,898,678	1.2
Sinochem Offshore Capital Co., Ltd.	2.38%	09/23/2031	760	592,943	0.1
Southern Gas Corridor CJSC	6.88%	03/24/2026	2,311	2,357,220	0.5
State Oil Co. of the Azerbaijan Republic	6.95%	03/18/2030	1,661	1,707,724	0.4
Transnet Soc Ltd.	8.25%	02/06/2028	3,042	3,049,605	0.6
Trinidad Generation UnLtd.	5.25%	11/04/2027	260	253,825	0.1
				<u>93,257,844</u>	<u>19.1</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
Absa Group Ltd.(c)	6.38%	05/27/2026	638	593,260	0.1
Acu Petroleo Luxembourg SARL	7.50%	01/13/2032	887	799,660	0.2
Adani Green Energy Ltd.	4.38%	09/08/2024	1,725	1,399,730	0.3
AES Andes SA	6.35%	10/07/2079	1,162	1,100,995	0.2
Alfa Desarrollo SpA	4.55%	09/27/2051	1,863	1,369,440	0.3
Aris Mining Corp.	6.88%	08/09/2026	2,100	1,780,143	0.4
Autopistas del Sol SA/Costa Rica	7.38%	12/30/2030	1,928	1,757,851	0.4
Bank Hapoalim BM	3.26%	01/21/2032	734	625,735	0.1
Braskem Idesa SAPI	6.99%	02/20/2032	1,349	940,927	0.2
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030	403	338,316	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	7.25%	02/13/2033	790	771,609	0.2
BRF SA	4.88%	01/24/2030	831	630,791	0.1
CA Magnum Holdings	5.38%	10/31/2026	542	494,575	0.1
Cemex SAB de CV	7.38%	06/05/2027	963	974,074	0.2
China Great Wall International Holdings V Ltd.	2.88%	11/23/2026	294	258,591	0.1
China Modern Dairy Holdings Ltd.	2.13%	07/14/2026	630	533,269	0.1
Cia de Minas Buenaventura SAA	5.50%	07/23/2026	782	657,027	0.1
Cometa Energia SA de CV	6.38%	04/24/2035	1,250	1,209,570	0.3
Country Garden Holdings Co., Ltd.	3.13%	10/22/2025	200	128,500	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
CSN Resources SA	4.63%	06/10/2031	USD 1,323	\$ 1,036,504	0.2%
CT Trust	5.13%	02/03/2032	200	157,855	0.0
Ecopetrol SA	5.88%	11/02/2051	2,648	1,690,218	0.3
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	595	529,550	0.1
Ecopetrol SA	8.88%	01/13/2033	499	487,773	0.1
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	1,017	968,209	0.2
Empresa Generadora de Electricidad Haina SA	5.63%	11/08/2028	1,121	969,777	0.2
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.25%	07/18/2029	914	668,820	0.1
Engie Energia Chile SA	4.50%	01/29/2025	790	726,018	0.2
Freeport Indonesia PT	5.32%	04/14/2032	846	778,413	0.2
GNL Quintero SA	4.63%	07/31/2029	153	146,058	0.0
Gran Tierra Energy International Holdings Ltd.	6.25%	02/15/2025	470	405,610	0.1
Gran Tierra Energy, Inc.	7.75%	05/23/2027	807	659,698	0.1
Greenko Dutch BV	3.85%	03/29/2026	869	765,742	0.2
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	3.25%	11/13/2024	465	427,161	0.1
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	3.75%	05/29/2024	227	213,848	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	4.50%	05/29/2029	392	316,981	0.1
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	6.38%	06/01/2028	433	403,373	0.1
India Clean Energy Holdings	4.50%	04/18/2027	1,455	1,129,717	0.2
Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	8.25%	10/22/2025	945	923,738	0.2
Intercorp Financial Services, Inc.	4.13%	10/19/2027	673	598,045	0.1
Iochpe-Maxion Austria GmbH/ Maxion Wheels de Mexico S de RL de CV	5.00%	05/07/2028	1,100	892,925	0.2
Israel Electric Corp. Ltd., Series G	3.75%	02/22/2032	204	175,287	0.0
Joy Treasure Assets Holdings, Inc.	4.50%	03/20/2029	740	661,976	0.1
JSW Hydro Energy Ltd.	4.13%	05/18/2031	1,429	1,170,487	0.2
JSW Steel Ltd.	3.95%	04/05/2027	200	175,500	0.0
JSW Steel Ltd.	5.05%	04/05/2032	230	185,696	0.0
Kallpa Generacion SA	4.13%	08/16/2027	925	840,767	0.2
Leviathan Bond Ltd.	6.75%	06/30/2030	1,415	1,319,035	0.3
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	1,863	1,606,440	0.3
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	5.88%	07/05/2034	1,474	1,398,112	0.3
MARB BondCo PLC	3.95%	01/29/2031	1,675	1,197,625	0.2
Medco Oak Tree Pte Ltd.	7.38%	05/14/2026	1,275	1,233,562	0.3
Melco Resorts Finance Ltd.	5.75%	07/21/2028	1,055	907,300	0.2
Minejesa Capital BV	5.63%	08/10/2037	1,015	809,386	0.2
National Central Cooling Co. PJSC	2.50%	10/21/2027	974	860,529	0.2
Natura Cosmeticos SA	4.13%	05/03/2028	1,601	1,243,176	0.3
NBM US Holdings, Inc.	7.00%	05/14/2026	2,240	2,160,883	0.4
OEC Finance Ltd.(d)	4.38%	10/25/2029	981	27,871	0.0
OEC Finance Ltd.(d)	5.25%	12/27/2033	1,648	49,395	0.0
OEC Finance Ltd.(d)	7.13%	12/26/2046	582	19,901	0.0
Power Finance Corp., Ltd., Series G	3.35%	05/16/2031	620	502,095	0.1
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	4.90%	05/13/2026	200	54,000	0.0
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	6.25%	08/10/2024	350	97,300	0.0
Rede D'or Finance SARL	4.95%	01/17/2028	835	756,093	0.2
ReNew Wind Energy AP2/ ReNew Power Pvt Ltd. other 9 Subsidiaries	4.50%	07/14/2028	755	619,100	0.1
Saudi Arabian Oil Co.	1.63%	11/24/2025	2,450	2,223,834	0.5
SEPLAT Energy PLC	7.75%	04/01/2026	1,079	907,709	0.2
Shimao Group Holdings Ltd.(a)	5.20%	01/16/2027	1,390	232,825	0.1
Shimao Group Holdings Ltd.(a)	5.60%	07/15/2026	400	67,000	0.0
Shinhan Financial Group Co., Ltd.(c)	2.88%	05/12/2026	285	245,955	0.1
SierraCol Energy Andina LLC	6.00%	06/15/2028	1,367	1,067,371	0.2
Studio City Co., Ltd.	7.00%	02/15/2027	254	238,760	0.1
Studio City Finance Ltd.	6.50%	01/15/2028	830	701,765	0.1
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	3.25%	08/15/2030	2,279	1,709,250	0.4
Times China Holdings Ltd.(a)	5.55%	06/04/2024	250	41,063	0.0
Times China Holdings Ltd.(a)	5.75%	01/14/2027	530	84,237	0.0
Times China Holdings Ltd.(a)	6.20%	03/22/2026	200	31,788	0.0
Times China Holdings Ltd.(a)	6.75%	07/08/2025	200	31,000	0.0
TransJamaican Highway Ltd.	5.75%	10/10/2036	1,772	1,485,230	0.3
Tullow Oil PLC	10.25%	05/15/2026	1,421	1,142,129	0.2
UEP Penonome II SA	6.50%	10/01/2038	3,451	2,650,964	0.5
Vale Overseas Ltd.	3.75%	07/08/2030	1,370	1,186,351	0.2
Vedanta Resources Finance II PLC	13.88%	01/21/2024	720	587,835	0.1
Volcan Cia Minera SAA	4.38%	02/11/2026	795	617,119	0.1
Weibo Corp.	3.38%	07/08/2030	314	251,161	0.1
Woori Bank(c)	4.25%	10/04/2024	200	190,225	0.0
Xiaomi Best Time International Ltd.	2.88%	07/14/2031	254	192,294	0.0
Yango Justice International Ltd.(a)	7.50%	02/17/2025	691	17,275	0.0
Yango Justice International Ltd.(a)	8.25%	11/25/2023	200	5,000	0.0
Yango Justice International Ltd.(a)	9.25%	04/15/2023	530	13,250	0.0
				65,253,002	13.3

	Zinssatz	Datum	Anteile/Kontrakte	Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE						
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2031	BRL	29,120	\$ 4,702,910	1.0%
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series NTNF	10.00%	01/01/2029		74,952	12,506,740	2.6
Dominican Republic International Bond	13.63%	02/03/2033	DOP	58,050	1,166,343	0.2
Republic of South Africa Government Bond, Series 2030	8.00%	01/31/2030	ZAR	48,492	2,368,769	0.5
Republic of South Africa Government Bond, Series 2032	8.25%	03/31/2032		66,254	3,104,558	0.6
Republic of South Africa Government Bond, Series 2035	8.88%	02/28/2035		39,835	1,842,912	0.4
					<u>25,692,232</u>	<u>5.3</u>
SCHATZOBLIGATIONEN						
Mexican Bonos, Series M	8.00%	11/07/2047	MXN	55,920	2,682,779	0.5
Peru Government Bond	5.94%	02/12/2029	PEN	19,825	4,780,234	1.0
U.S. Treasury Notes	4.13%	11/15/2032	USD	3,765	3,822,063	0.8
					<u>11,285,076</u>	<u>2.3</u>
SCHATZWECHSEL						
Egypt Treasury Bills	0.00%	07/18/2023	EGP	35,950	1,085,090	0.2
Egypt Treasury Bills	0.00%	08/08/2023		65,575	1,955,780	0.4
Egypt Treasury Bills, Series 364D	0.00%	04/11/2023		18,625	594,754	0.1
					<u>3,635,624</u>	<u>0.7</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN						
AB SICAV I - Emerging Market Corporate Debt Portfolio - Class S				120,265	2,945,280	0.6
GEKAUFTE OPTIONEN – VERKAUFSOPTIONEN						
SWAPTIONS						
IRS Swaption, Morgan Stanley Capital Services LLC Expiration: Aug 2023, Exercise Rate: 3.67%				50,570,000	1,051,776	0.2
INFLATIONSGBUNDENE WERTPAPIERE						
Fideicomiso PA Concesion Ruta al Mar	6.75%	02/15/2044	COP	4,530,814	532,904	0.1
					<u>467,959,419</u>	<u>95.6</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE						
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
BBFI Liquidating Trust(c) (e)	0.00%	12/30/2099	USD	5,162	2,193,784	0.5
Digicel Group Holdings Ltd.(c) (d)	7.00%	03/15/2023		231	18,459	0.0
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058		3,385	6,342	0.0
Tonon Luxembourg SA(a) (e)	6.50%	10/31/2024		1,523	152	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(b) (e)	10.50%	01/28/2018		1,016	102	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(b) (e)	11.75%	02/09/2022		2,561	256	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(b) (e)	10.87%	01/13/2020		2,474	247	0.0
					<u>2,219,342</u>	<u>0.5</u>
QUASI-STAAATSANLEIHEN						
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	5.00%	01/25/2047		240	214,395	0.0
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC(a)	7.63%	11/08/2026		1,322	251,180	0.1
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC(b)	7.38%	09/15/2022		4,396	1,002,837	0.2
State Agency of Roads of Ukraine	6.25%	06/24/2030		2,984	517,165	0.1
					<u>1,985,577</u>	<u>0.4</u>
STAATSANLEIHEN						
Ghana Government International Bond(a)	8.63%	06/16/2049		3,367	1,224,746	0.3
Ukraine Government International Bond	6.75%	06/20/2028	EUR	1,222	211,083	0.0
					<u>1,435,829</u>	<u>0.3</u>
					<u>5,640,748</u>	<u>1.2</u>
Gesamtanlagen						
(Kosten \$612,306,644)					\$ 473,600,167	96.8%
Termineinlagen						
BBH, Grand Cayman(f)	4.10 %	–			230	0.0
HSBC, Paris(f)	1.53 %	–			80,031	0.0
Scotiabank, Toronto(f)	3.33 %	–			26	0.0
SMBC, London(f)	2.92 %	–			198	0.0
SMBC, Tokyo(f)	3.93 %	–			4,350,243	0.9
Standard Chartered Bank, Johannesburg(f)	5.62 %	–			31,307	0.0
Termineinlagen insgesamt					<u>4,462,035</u>	<u>0.9</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					<u>11,440,436</u>	<u>2.3</u>
Nettovermögen					<u>\$ 489,502,638</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Long					
U.S. 10 Yr Ultra Futures	06/21/2023	12	\$ 1,405,445	\$ 1,406,250	\$ 805
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	06/30/2023	29	5,921,188	5,908,070	(13,118)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	06/21/2023	31	3,468,125	3,461,344	(6,781)
Short					
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	06/21/2023	12	1,625,438	1,620,750	4,688
					\$ (14,406)
				Wertsteigerung	\$ 5,493
				Wertminderung	\$ (19,899)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Bank of America, NA	USD 5,610	BRL 29,601	03/02/2023	\$ 43,986
Bank of America, NA	USD 451	BRL 2,320	03/02/2023	(7,527)
Bank of America, NA	COP 11,248,478	USD 2,335	03/17/2023	27,232
Bank of America, NA	EUR 3,786	USD 4,029	05/11/2023	8,631
BNP Paribas SA	MXN 49,910	USD 2,706	03/16/2023	(14,354)
BNP Paribas SA	USD 1,939	COP 9,200,412	03/17/2023	(52,061)
BNP Paribas SA	USD 2,374	ZAR 42,787	04/20/2023	(54,491)
Brown Brothers Harriman & Co.	ZAR 9,412	USD 514	04/20/2023	3,418
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 75	USD 11	03/06/2023	(39)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 11	CNH 75	03/06/2023	(299)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 79	USD 12	03/08/2023	307
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 11	CNH 75	03/08/2023	40
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 12	CNH 79	03/08/2023	(307)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2,976	USD 3,180	03/17/2023	28,494
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 46	EUR 43	03/17/2023	121
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 90,835	EUR 84,737	03/17/2023	(1,123,840)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 3,594	USD 2,452	03/24/2023	32,111
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 10	USD 7	03/24/2023	(2)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 35	USD 26	03/24/2023	201
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF 0*	USD 0*	03/24/2023	7
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 14	USD 17	03/24/2023	60
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 228	USD 142	03/24/2023	1,132
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 279	USD 62	03/24/2023	(287)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 214	USD 160	03/24/2023	1,002
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 1	USD 1	03/24/2023	(1)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 47,324	AUD 69,383	03/24/2023	(596,309)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 818	CAD 1,108	03/24/2023	(5,533)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 19	CNH 17	03/24/2023	(263)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 498	GBP 411	03/24/2023	(2,574)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3	NZD 5	03/24/2023	9
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,406	NZD 3,859	03/24/2023	(20,383)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,332	PLN 5,941	03/24/2023	1,384
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 4,673	SGD 6,255	03/24/2023	(32,355)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 24,605	ZAR 449,412	03/24/2023	(182,856)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 32,091	USD 1,760	03/24/2023	16,506
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 214	USD 12	03/24/2023	(37)
Citibank, NA	ZAR 5,494	USD 296	04/20/2023	(1,810)
Citibank, NA	EUR 617	USD 657	05/11/2023	1,674
Deutsche Bank AG	USD 2,769	ZAR 50,204	04/20/2023	(46,886)
JPMorgan Chase Bank, NA	BRL 37,216	USD 7,388	03/02/2023	279,271
Morgan Stanley & Co. LLC	BRL 57,334	USD 11,202	03/02/2023	251,035
Morgan Stanley & Co. LLC	USD 12,209	BRL 62,630	03/02/2023	(245,900)
Morgan Stanley & Co. LLC	BRL 62,630	USD 12,127	04/04/2023	242,820
Morgan Stanley & Co. LLC	ZAR 124,387	USD 6,896	04/20/2023	151,716
UBS AG	USD 2,557	ZAR 47,223	04/20/2023	3,803
				\$ (1,293,154)
			Wertsteigerung	\$ 1,094,960
			Wertminderung	\$ (2,388,114)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

VERKAUFTE ZINS-SWAPTIONS

Bezeichnung	Ausübungspreis	Fälligkeit	Nominalbetrag (000)	Prämien erhalten	Marktwert
Put - OTC - 1 Year Interest Rate Swap	3.92%	08/15/2023	USD 50,570	\$ 536,184	\$ (699,788)

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschlussdatum	Nominalbetrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Verkaufskontrakte					
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	CDX-EM Series 38, 5 Year Index	12/20/2027	USD 2,880	\$ (163,503)	\$ 22,302
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Federative Republic of Brazil	12/20/2027	USD 1,600	(85,680)	25,883
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	People's Republic of China	12/20/2027	USD 2,230	27,647	11,997
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Republic of Colombia	12/20/2027	USD 1,980	(148,287)	12,646
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Republic of Indonesia	12/20/2027	USD 3,040	10,302	24,345
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Republic of Turkey	12/20/2027	USD 3,530	(603,746)	40,589
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Republic of Turkey	12/20/2027	USD 1,778	(304,096)	10,520
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	United Mexican States	12/20/2027	USD 1,470	(9,846)	15,509
Insgesamt				\$ 1,441,000	\$ 163,791

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominalbetrag (000)	Abschlussdatum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 23,670	02/21/2028	3.866%	1 Day SOFR	\$ 127,263
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 5,040	02/21/2053	1 Day SOFR	3.237%	(12,962)
Insgesamt					\$ 114,301
				Wertsteigerung	\$ 127,263
				Wertminderung	\$ (12,962)
Swaps insgesamt					\$ 278,092

* Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

- (a) Not leidend.
- (b) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (c) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (d) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (e) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (f) Tagesgeld.

Währungskürzel:

- AUD – Australian Dollar
- BRL – Brazilian Real
- CAD – Canadian Dollar
- CHF – Swiss Franc
- CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
- COP – Colombian Peso
- DOP – Dominican Peso
- EGP – Egyptian Pound
- EUR – Euro
- GBP – Great British Pound
- MXN – Mexican Peso
- NZD – New Zealand Dollar
- PEN – Peruvian Sol
- PLN – Polish Zloty
- SGD – Singapore Dollar
- USD – United States Dollar
- ZAR – South African Rand

Glossar:

CBT	– Chicago Board of Trade
CJSC	– Closed Joint Stock Company
CME	– Chicago Mercantile Exchange
INTRCONX	– Inter-Continental Exchange
JSC	– Joint Stock Company
PJSC	– Public Joint Stock Company
SOFR	– Secured Overnight Financing Rate

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettowert- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2021-1A, Class M1C(a)	7.43%	03/25/2031	USD 3,000	\$ 2,999,997	0.4%
Series 2021-1A, Class M2(a)	9.33%	03/25/2031	1,000	1,011,551	0.1
Series 2022-1, Class M2(a)	9.08%	01/26/2032	500	489,361	0.1
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2020-R02, Class 2B1(a)	7.62%	01/25/2040	4,000	3,801,835	0.5
Series 2020-SBT1, Class 1B1(a)	11.37%	02/25/2040	1,000	943,026	0.1
Series 2020-SBT1, Class 2B1(a)	11.22%	02/25/2040	1,000	955,420	0.1
Series 2020-SBT1, Class 2M2(a)	8.27%	02/25/2040	2,840	2,894,588	0.4
Series 2021-R01, Class 1B2(a)	10.48%	10/25/2041	500	456,723	0.1
Series 2022-R01, Class 1B2(a)	10.48%	12/25/2041	2,500	2,220,939	0.3
Series 2022-R01, Class 1M2(a)	6.38%	12/25/2041	7,215	6,952,509	0.9
Series 2022-R02, Class 2B1(a)	8.98%	01/25/2042	2,000	1,936,495	0.2
Series 2022-R02, Class 2B2(a)	12.13%	01/25/2042	1,000	946,844	0.1
Series 2022-R05, Class 2B2(a)	11.48%	04/25/2042	2,000	1,980,099	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2015-DNA1, Class B(a)	13.82%	10/25/2027	7,245	7,641,468	0.9
Series 2015-DNA1, Class M3(a)	7.92%	10/25/2027	1,139	1,151,767	0.1
Series 2015-DNA2, Class B(a)	12.16%	12/25/2027	6,884	7,023,441	0.9
Series 2015-DNA3, Class B(a)	13.97%	04/25/2028	6,429	6,716,848	0.8
Series 2015-HQ2, Class B(a)	12.57%	05/25/2025	2,834	2,884,119	0.4
Series 2015-HQA1, Class B(a)	13.41%	03/25/2028	3,453	3,505,199	0.4
Series 2015-HQA2, Class B(a)	15.12%	05/25/2028	4,296	4,665,731	0.6
Series 2016-DNA1, Class B(a)	14.61%	07/25/2028	1,914	2,038,356	0.2
Series 2016-DNA2, Class B(a)	15.12%	10/25/2028	6,748	7,252,920	0.9
Series 2016-DNA3, Class B(a)	15.87%	12/25/2028	1,480	1,627,405	0.2
Series 2016-DNA4, Class B(a)	13.22%	03/25/2029	989	1,008,490	0.1
Series 2016-HQA1, Class B(a)	17.37%	09/25/2028	2,483	2,818,976	0.3
Series 2016-HQA2, Class B(a)	16.12%	11/25/2028	497	549,934	0.1
Series 2018-HQA2, Class B2(a)	15.62%	10/25/2048	7,550	8,750,837	1.1
Series 2018-SPI1, Class B(b)	3.78%	02/25/2048	1,250	701,034	0.1
Series 2018-SPI2, Class B(b)	3.83%	05/25/2048	1,578	902,884	0.1
Series 2018-SPI3, Class B(b)	4.16%	08/25/2048	730	434,935	0.1
Series 2018-SPI4, Class B(b)	4.51%	11/25/2048	1,900	981,189	0.1
Series 2019-DNA1, Class B2(a)	15.37%	01/25/2049	3,500	4,056,656	0.5
Series 2019-DNA3, Class B1(a)	7.87%	07/25/2049	2,000	2,049,618	0.2
Series 2019-DNA4, Class B2(a)	10.87%	10/25/2049	3,850	3,830,948	0.5
Series 2019-HQA2, Class B2(a)	15.87%	04/25/2049	1,900	2,159,163	0.3
Series 2019-HQA3, Class B2(a)	12.12%	09/25/2049	5,650	5,592,968	0.7
Series 2020-DNA1, Class B2(a)	9.87%	01/25/2050	7,500	6,988,891	0.9
Series 2020-DNA2, Class B2(a)	9.42%	02/25/2050	8,651	7,837,448	1.0
Series 2020-DNA5, Class B2(a)	15.98%	10/25/2050	3,000	3,565,127	0.4
Series 2020-HQA1, Class B2(a)	9.72%	01/25/2050	6,000	5,111,050	0.6
Series 2020-HQA2, Class B2(a)	12.22%	03/25/2050	6,000	5,835,518	0.7
Series 2021-DNA1, Class B2(a)	9.23%	01/25/2051	2,000	1,682,078	0.2
Series 2021-DNA2, Class B1(a)	7.88%	08/25/2033	2,000	1,928,607	0.2
Series 2021-DNA2, Class B2(a)	10.48%	08/25/2033	1,250	1,103,822	0.1
Series 2021-DNA2, Class M2(a)	6.78%	08/25/2033	2,000	1,998,664	0.2
Series 2021-DNA3, Class B1(a)	7.98%	10/25/2033	4,000	3,879,951	0.5
Series 2021-DNA3, Class B2(a)	10.73%	10/25/2033	1,000	927,028	0.1
Series 2021-DNA5, Class B1(a)	7.53%	01/25/2034	4,000	3,780,877	0.5
Series 2021-DNA5, Class B2(a)	9.98%	01/25/2034	3,000	2,519,412	0.3
Series 2021-DNA6, Class B1(a)	7.88%	10/25/2041	1,000	953,879	0.1
Series 2021-DNA6, Class B2(a)	11.98%	10/25/2041	1,500	1,373,581	0.2
Series 2021-DNA6, Class M2(a)	5.98%	10/25/2041	4,700	4,515,057	0.6
Series 2021-DNA7, Class B1(a)	8.13%	11/25/2041	2,000	1,902,745	0.2
Series 2021-DNA7, Class B2(a)	12.28%	11/25/2041	1,000	931,931	0.1
Series 2021-DNA7, Class M2(a)	6.28%	11/25/2041	4,650	4,448,440	0.5
Series 2021-HQA3, Class B1(a)	7.83%	09/25/2041	2,000	1,818,086	0.2
Series 2021-HQA3, Class M1(a)	5.33%	09/25/2041	2,571	2,477,884	0.3
Series 2021-HQA4, Class B1(a)	8.23%	12/25/2041	2,000	1,826,237	0.2
Series 2022-DNA1, Class B1(a)	7.88%	01/25/2042	1,000	937,093	0.1
Series 2022-DNA1, Class B2(a)	11.58%	01/25/2042	1,500	1,330,611	0.2
Series 2022-DNA1, Class M1B(a)	6.33%	01/25/2042	7,812	7,516,918	0.9
Series 2022-DNA2, Class B1(a)	9.23%	02/25/2042	1,000	968,888	0.1
Series 2022-DNA2, Class B2(a)	12.98%	02/25/2042	500	468,364	0.1
Series 2022-DNA2, Class M1B(a)	6.88%	02/25/2042	5,000	4,872,459	0.6
Series 2022-HQA1, Class M1A(a)	6.58%	03/25/2042	2,354	2,359,087	0.3

AB FCP I
Mortgage Income Portfolio

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Federal National Mortgage Association Connecticut					
Avenue Securities					
Series 2013-C01, Class M2(a)	9.87%	10/25/2023	USD 428	\$ 438,879	0.1%
Series 2014-C04, Class 1M2(a)	9.52%	11/25/2024	419	435,690	0.1
Series 2016-C01, Class 1B(a)	16.37%	08/25/2028	2,683	3,030,466	0.4
Series 2016-C01, Class 2M2(a)	11.56%	08/25/2028	442	468,161	0.1
Series 2016-C02, Class 1B(a)	16.87%	09/25/2028	6,060	6,869,879	0.8
Series 2016-C03, Class 1B(a)	16.37%	10/25/2028	3,473	3,900,581	0.5
Series 2016-C03, Class 2B(a)	17.37%	10/25/2028	3,221	3,679,476	0.4
Series 2016-C04, Class 1B(a)	14.86%	01/25/2029	3,212	3,486,277	0.4
Series 2016-C05, Class 2B(a)	15.36%	01/25/2029	4,916	5,353,521	0.7
Series 2016-C06, Class 1B(a)	13.87%	04/25/2029	5,043	5,342,160	0.7
Series 2016-C07, Class 2B(a)	14.12%	05/25/2029	3,559	3,737,168	0.5
Series 2021-R02, Class 2B1(a)	7.78%	11/25/2041	3,000	2,858,044	0.3
Series 2021-R02, Class 2B2(a)	10.68%	11/25/2041	1,000	918,222	0.1
PMT Credit Risk Transfer Trust					
Series 2019-2R, Class A(a)	7.26%	05/27/2023	4,490	4,431,421	0.5
Series 2019-3R, Class A(a)	8.36%	11/27/2031	866	848,115	0.1
Radnor Re Ltd., Series 2021-2, Class M2(a)	9.48%	11/25/2031	4,000	4,042,820	0.5
STACR Trust, Series 2018-DNA3, Class B2(a)	12.37%	09/25/2048	3,015	3,146,609	0.4
Triangle Re Ltd., Series 2021-3, Class M1B(a)	7.38%	02/25/2034	1,500	1,469,394	0.2
				246,250,889	30.3
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH					
Alternative Loan Trust					
Series 2005-50CB, Class 1A1	5.50%	11/25/2035	816	668,539	0.1
Series 2006-11CB, Class 1A2	6.00%	05/25/2036	795	479,075	0.1
Series 2006-28CB, Class A14	6.25%	10/25/2036	393	218,380	0.0
Series 2006-28CB, Class A18	6.00%	10/25/2036	665	358,239	0.0
Angel Oak Mortgage Trust, Series 2021-2, Class A1	0.99%	04/25/2066	3,137	2,607,297	0.3
Brean Asset Backed Securities Trust					
Series 2021-RM2, Class A	1.75%	10/25/2061	5,150	4,486,750	0.5
Series 2021-RM2, Class M2	1.75%	10/25/2061	1,537	1,206,268	0.1
Series 2022-RM3, Class M2	1.75%	02/25/2062	2,496	1,663,740	0.2
Chase Mortgage Finance Trust,					
Series 2007-S5, Class 1A17	6.00%	07/25/2037	1,563	760,436	0.1
CHL Mortgage Pass-Through Trust,					
Series 2006-10, Class 1A8	6.00%	05/25/2036	1,165	564,881	0.1
CitiMortgage Alternative Loan Trust,					
Series 2007-A6, Class 1A11	6.00%	06/25/2037	100	85,867	0.0
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust,					
Series 2006-FA2, Class 1A3	6.00%	05/25/2036	169	76,847	0.0
Flagstar Mortgage Trust, Series 2017-1, Class B3	3.62%	03/25/2047	1,555	1,312,610	0.2
JPMorgan Mortgage Trust					
Series 2017-2, Class B3	3.65%	05/25/2047	1,679	1,394,735	0.2
Series 2017-4, Class B3	3.87%	11/25/2048	1,952	1,636,511	0.2
Series 2017-6, Class B3	3.78%	12/25/2048	1,330	1,102,580	0.1
Series 2018-3, Class B2	3.71%	09/25/2048	2,533	2,156,189	0.3
Series 2018-6, Class B2	3.89%	12/25/2048	1,584	1,382,485	0.2
Series 2018-9, Class B2	4.22%	02/25/2049	2,392	2,087,885	0.3
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust,					
Series 2006-7, Class 4A4	6.00%	06/25/2036	430	236,599	0.0
Shellpoint Co-Originator Trust, Series 2017-1, Class B3	3.60%	04/25/2047	1,824	1,535,931	0.2
Verus Securitization Trust 2022-4, Series 2022-4, Class A1	4.47%	04/25/2067	6,948	6,592,442	0.8
				32,614,286	4.0
NICHT STAATLICH VARIABEL VERZINSLICH					
Alternative Loan Trust, Series 2005-19CB, Class A2(a) (c)	6.78%	06/25/2035	64	50,497	0.0
Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust					
Series 2005-AC7, Class A2(a) (c)	8.38%	10/25/2035	238	179,580	0.0
Series 2005-AC9, Class A4(a) (c)	8.27%	12/25/2035	247	138,216	0.0
Chase Mortgage Finance Corp.					
Series 2016-SH1, Class M4(b)	3.75%	04/25/2045	1,036	856,777	0.1
Series 2016-SH2, Class M4(b)	3.75%	12/25/2045	484	412,945	0.1
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates,					
Series 2005-9, Class 4A1(a) (c)	6.83%	10/25/2035	56	53,199	0.0
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust,					
Series 2005-FA8, Class 1A12(a)	5.50%	11/25/2035	86	45,038	0.0
Lehman Mortgage Trust, Series 2007-1, Class 3A2(a) (c)	2.63%	02/25/2037	885	71,001	0.0
Residential Accredit Loans, Inc. Trust,					
Series 2006-QQ3, Class A1(a)	5.04%	04/25/2046	2,333	671,237	0.1
Sequoia Mortgage Trust, Series 2018-7, Class B2(b)	4.25%	09/25/2048	2,311	2,061,211	0.3
Structured Asset Securities Corp Trust,					
Series 2006-11, Class A3(a)	4.69%	10/28/2035	6,326	4,117,851	0.5
				8,657,552	1.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 3928, Class SE(a) (c)	1.99%	09/15/2041	USD 3,453	\$ 353,951	0.1%
Series 4416, Class BS(a) (c)	1.51%	12/15/2044	1,452	126,176	0.0
Series 4719, Class JS(a) (c)	1.56%	09/15/2047	2,607	255,218	0.0
Series 4767, Class SB(a) (c)	1.61%	03/15/2048	2,896	276,167	0.0
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2012-122, Class MS(a) (c)	1.48%	11/25/2042	1,466	154,266	0.0
Series 2013-15, Class SA(a) (c)	1.53%	03/25/2043	3,470	336,435	0.1
Series 2014-40, Class HS(a) (c)	2.08%	07/25/2044	2,086	297,097	0.0
Series 2015-90, Class SL(a) (c)	1.53%	12/25/2045	4,098	389,588	0.1
Series 2016-106, Class ES(a) (c)	1.38%	01/25/2047	1,439	136,219	0.0
Series 2017-20, Class SJ(a) (c)	1.48%	04/25/2047	3,423	333,446	0.0
Series 2018-28, Class SB(a) (c)	1.58%	05/25/2048	3,632	374,564	0.1
Series 2018-30, Class SA(a) (c)	1.58%	05/25/2048	2,854	273,343	0.0
Series 2018-58, Class SA(a) (c)	1.58%	08/25/2048	1,828	201,625	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2014-181, Class TV(a) (c)	1.66%	02/16/2035	2,904	110,170	0.0
Series 2015-3, Class DS(a) (c)	1.00%	11/20/2041	2,258	32,396	0.0
				<u>3,650,661</u>	<u>0.4</u>
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs,					
Series 5040, Class AI(d)	3.50%	11/25/2050	2,569	424,414	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2015-30, Class EI(d)	5.00%	05/25/2045	473	79,102	0.0
Series 2016-64, Class BI(d)	5.00%	09/25/2046	4,105	606,092	0.1
Government National Mortgage Association,					
Series 2021-117, Class MI(d)	3.50%	05/20/2042	14,276	1,992,882	0.2
				<u>3,102,490</u>	<u>0.4</u>
				<u>294,275,878</u>	<u>36.2</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E	4.65%	02/10/2036	2,000	1,656,042	0.2
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust,					
Series 2013-WBRK, Class D	3.53%	03/10/2037	3,000	2,132,974	0.3
Banc of America Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-UBS7, Class AS	3.99%	09/15/2048	1,140	1,071,048	0.1
Series 2015-UBS7, Class XA(d)	0.75%	09/15/2048	63,905	987,782	0.1
BANK					
Series 2017-BNK5, Class AS	3.62%	06/15/2060	2,500	2,271,704	0.3
Series 2017-BNK6, Class AS	3.74%	07/15/2060	2,500	2,285,268	0.3
Series 2018-BN13, Class AS	4.47%	08/15/2061	5,000	4,701,466	0.6
BBCMS Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class AS	3.90%	02/15/2050	2,500	2,310,665	0.3
Benchmark Mortgage Trust					
Series 2018-B1, Class AM	3.88%	01/15/2051	6,809	6,224,128	0.8
Series 2018-B2, Class AS	4.08%	02/15/2051	2,500	2,301,124	0.3
CCUBS Commercial Mortgage Trust,					
Series 2017-C1, Class XA(d)	1.01%	11/15/2050	12,076	418,542	0.1
CFCRE Commercial Mortgage Trust					
Series 2016-C4, Class AM	3.69%	05/10/2058	190	176,535	0.0
Series 2016-C7, Class A3	3.84%	12/10/2054	2,500	2,317,750	0.3
Citigroup Commercial Mortgage Trust					
Series 2013-GC11, Class D	4.26%	04/10/2046	1,056	1,040,236	0.1
Series 2013-GC17, Class D	5.11%	11/10/2046	2,430	2,136,591	0.3
Series 2015-GC29, Class XA(d)	1.02%	04/10/2048	6,317	107,564	0.0
Series 2016-P6, Class AS	4.03%	12/10/2049	3,310	3,085,778	0.4
Series 2017-P8, Class XA(d)	0.87%	09/15/2050	42,723	1,292,835	0.2
Series 2018-C6, Class XA(d)	0.77%	11/10/2051	7,839	260,091	0.0
Commercial Mortgage Trust					
Series 2010-C1, Class D	5.79%	07/10/2046	2,227	2,163,530	0.3
Series 2010-C1, Class F	4.00%	07/10/2046	3,780	3,403,057	0.4
Series 2012-CR1, Class B	4.61%	05/15/2045	471	452,239	0.1
Series 2012-CR2, Class G	4.25%	08/15/2045	1,500	748,257	0.1
Series 2012-CR3, Class E	4.64%	10/15/2045	2,173	1,256,039	0.2
Series 2012-CR3, Class XA(d)	1.23%	10/15/2045	266	26	0.0
Series 2013-LC6, Class D	4.07%	01/10/2046	371	348,298	0.0
Series 2014-CR16, Class D	4.93%	04/10/2047	1,841	1,580,788	0.2
Series 2014-CR19, Class XA(d)	0.93%	08/10/2047	68,009	653,809	0.1
Series 2014-CR20, Class XA(d)	0.94%	11/10/2047	7,276	87,050	0.0
Series 2014-LC17, Class B	4.49%	10/10/2047	2,000	1,919,538	0.2
Series 2014-UBS2, Class D	4.98%	03/10/2047	1,250	1,117,751	0.1
Series 2014-UBS6, Class AM	4.05%	12/10/2047	190	182,165	0.0

AB FCP I
Mortgage Income Portfolio

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Series 2015-CR22, Class XA(d)	0.82%	03/10/2048	USD 13,534	\$ 177,944	0.0%
Series 2015-LC19, Class XA(d)	1.08%	02/10/2048	45,799	683,325	0.1
Series 2016-DC2, Class XA(d)	0.93%	02/10/2049	45,400	970,307	0.1
CSAIL Commercial Mortgage Trust					
Series 2017-C8, Class XA(d)	1.10%	06/15/2050	52,541	1,881,012	0.2
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2011-GC5, Class C	5.15%	08/10/2044	4,850	3,503,581	0.4
Series 2011-GC5, Class D	5.15%	08/10/2044	493	204,301	0.0
Series 2013-GC12, Class C	4.18%	06/10/2046	5,540	5,481,226	0.7
Series 2013-GC13, Class C	4.08%	07/10/2046	4,537	3,266,863	0.4
Series 2013-GC13, Class D	4.08%	07/10/2046	2,190	964,684	0.1
Series 2014-GC18, Class D	5.06%	01/10/2047	623	233,709	0.0
Series 2014-GC22, Class A5	3.86%	06/10/2047	2,500	2,429,107	0.3
Series 2014-GC22, Class XA(d)	0.94%	06/10/2047	6,400	46,305	0.0
Series 2016-GS3, Class A4	2.85%	10/10/2049	2,500	2,288,373	0.3
Series 2017-GS5, Class XA(d)	0.83%	03/10/2050	50,711	1,337,042	0.2
Series 2017-GS6, Class AS	3.64%	05/10/2050	2,000	1,825,788	0.2
Series 2017-GS7, Class XA(d)	1.08%	08/10/2050	25,788	946,856	0.1
Series 2017-GS8, Class XA(d)	0.94%	11/10/2050	35,264	1,171,082	0.1
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2013-C14, Class D	4.55%	08/15/2046	3,425	1,487,542	0.2
Series 2013-C17, Class D	4.88%	01/15/2047	2,535	2,342,939	0.3
Series 2014-C21, Class B	4.34%	08/15/2047	2,000	1,886,588	0.2
Series 2014-C22, Class XA(d)	0.80%	09/15/2047	90,237	739,909	0.1
Series 2014-C24, Class C	4.38%	11/15/2047	6,000	5,091,220	0.6
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2012-C6, Class E	4.96%	05/15/2045	2,250	1,776,483	0.2
Series 2012-C6, Class G	2.97%	05/15/2045	2,500	1,256,906	0.2
Series 2013-C10, Class B	3.67%	12/15/2047	827	807,726	0.1
Series 2013-C10, Class D	4.22%	12/15/2047	1,550	1,337,276	0.2
Series 2014-C20, Class XA(d)	0.80%	07/15/2047	9,376	46,820	0.0
Series 2016-JP2, Class XA(d)	1.77%	08/15/2049	39,465	1,795,836	0.2
Series 2016-JP3, Class B	3.40%	08/15/2049	2,000	1,707,631	0.2
LCCM, Series 2017-LC26, Class XA(d)	1.52%	07/12/2050	24,691	1,209,827	0.1
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust					
Series 2012-C6, Class E	4.54%	11/15/2045	425	333,629	0.0
Series 2014-C18, Class C	4.47%	10/15/2047	1,333	1,242,521	0.2
Series 2014-C19, Class D	3.25%	12/15/2047	1,225	939,879	0.1
Series 2014-C19, Class XA(d)	0.95%	12/15/2047	26,110	309,814	0.0
Series 2015-C20, Class XA(d)	1.24%	02/15/2048	50,366	803,090	0.1
Series 2015-C22, Class XA(d)	1.00%	04/15/2048	45,163	643,792	0.1
Series 2015-C25, Class XA(d)	1.04%	10/15/2048	28,735	520,212	0.1
Series 2017-C34, Class XA(d)	0.77%	11/15/2052	30,402	792,753	0.1
Morgan Stanley Capital I Trust					
Series 2011-C3, Class C	5.08%	07/15/2049	354	350,900	0.0
Series 2016-UBS9, Class XA(d)	1.12%	03/15/2049	55,303	1,376,168	0.2
UBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2017-C3, Class XA(d)	1.12%	08/15/2050	32,097	1,023,494	0.1
Series 2017-C4, Class XA(d)	1.09%	10/15/2050	17,381	672,198	0.1
Series 2017-C5, Class XA(d)	1.07%	11/15/2050	30,962	983,601	0.1
Series 2018-C10, Class XA(d)	0.87%	05/15/2051	72,923	2,643,438	0.3
Series 2018-C14, Class XA(d)	0.88%	12/15/2051	42,910	1,676,895	0.2
Series 2018-C15, Class XA(d)	0.90%	12/15/2051	19,524	767,478	0.1
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust					
Series 2013-C6, Class D	4.31%	04/10/2046	3,618	2,956,348	0.4
Series 2013-C6, Class XA(d)	0.97%	04/10/2046	865	72	0.0
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-C27, Class XA(d)	0.84%	02/15/2048	121,776	1,554,129	0.2
Series 2015-C29, Class C	4.22%	06/15/2048	3,852	3,516,247	0.4
Series 2015-C31, Class A3	3.43%	11/15/2048	1,147	1,095,878	0.1
Series 2015-NXS3, Class A4	3.62%	09/15/2057	1,425	1,349,375	0.2
Series 2015-SG1, Class AS	4.05%	09/15/2048	1,313	1,242,660	0.2
Series 2016-C32, Class XA(d)	1.21%	01/15/2059	54,473	1,534,235	0.2
Series 2016-C33, Class XA(d)	1.57%	03/15/2059	33,746	1,261,637	0.2
Series 2016-C35, Class A3	2.67%	07/15/2048	2,395	2,205,632	0.3
Series 2016-C35, Class B	3.44%	07/15/2048	2,500	2,124,606	0.3
Series 2016-C36, Class XA(d)	1.18%	11/15/2059	45,003	1,468,651	0.2
Series 2016-LC25, Class AS(b)	3.87%	12/15/2059	2,216	2,053,798	0.2
Series 2017-C38, Class XA(d)	0.97%	07/15/2050	28,324	890,336	0.1
Series 2017-C39, Class A5	3.42%	09/15/2050	2,500	2,300,385	0.3
Series 2018-C43, Class A4	4.01%	03/15/2051	5,750	5,420,093	0.7
Series 2018-C46, Class AS	4.38%	08/15/2051	4,500	4,193,828	0.5
Series 2018-C47, Class A4	4.44%	09/15/2061	5,000	4,792,212	0.6
Series 2018-C48, Class A5	4.30%	01/15/2052	5,372	5,105,725	0.6
Series 2018-C48, Class XA(d)	1.06%	01/15/2052	43,023	1,753,093	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
WF-RBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2011-C4, Class E	4.85%	06/15/2044	USD 713	\$ 570,861	0.1%
Series 2011-C5, Class E	5.57%	11/15/2044	923	875,296	0.1
Series 2012-C9, Class D	4.88%	11/15/2045	200	186,114	0.0
Series 2012-C10, Class B	3.74%	12/15/2045	2,500	2,310,408	0.3
Series 2012-C10, Class XA(d)	1.15%	12/15/2045	963	90	0.0
Series 2014-C22, Class XA(d)	0.78%	09/15/2057	32,490	273,328	0.0
Series 2014-C24, Class AS	3.93%	11/15/2047	3,164	3,015,112	0.4
Series 2014-C25, Class D	3.80%	11/15/2047	1,290	1,061,762	0.1
Series 2014-C25, Class XA(d)	0.79%	11/15/2047	21,894	229,125	0.0
				<u>170,009,776</u>	<u>20.9</u>
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS					
Ashford Hospitality Trust, Series 2018-KEYS, Class A(a)	5.59%	06/15/2035	3,000	2,949,163	0.4
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust,					
Series 2017-SCH, Class AF(a)	5.59%	11/15/2033	3,000	2,848,354	0.3
BHMS, Series 2018-ATLS, Class A(a)	5.84%	07/15/2035	3,000	2,944,108	0.3
Braemar Hotels & Resorts Trust,					
Series 2018-PRME, Class A(a)	5.41%	06/15/2035	5,000	4,830,519	0.6
BX Trust 2018-BILT, Series 2018-BILT, Class A(a)	5.39%	05/15/2030	5,000	4,950,041	0.6
DBWF Mortgage Trust, Series 2018-GLKS, Class E(a)	7.72%	12/19/2030	2,420	2,375,999	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp.,					
Series 2021-MN1, Class M2(a)	8.23%	01/25/2051	1,700	1,522,216	0.2
FS Rialto Issuer LLC, Series 2022-FL4, Class A(a)	6.33%	01/19/2039	5,000	4,824,351	0.6
HGI CRE CLO Ltd., Series 2022-FL3, Class A(a)	6.11%	04/20/2037	5,000	4,882,979	0.6
Morgan Stanley Capital I Trust					
Series 2019-BPR, Class D(a)	8.84%	05/15/2036	2,750	2,494,620	0.3
Series 2019-BPR, Class E(a)	9.59%	05/15/2036	2,250	1,870,754	0.2
RIAL Issuer Ltd, Series 2022-FL8, Class A(a)	6.81%	01/19/2037	3,000	2,974,963	0.4
				<u>39,468,067</u>	<u>4.8</u>
STAATLICHE CMBS					
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Multifamily Structured Pass-Through Certificates,					
Series K045, Class A2	3.02%	01/25/2025	13,187	12,704,250	1.6
				<u>222,182,093</u>	<u>27.3</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 9 Ltd., Series 2020-9A, Class D(a)	8.51%	01/20/2034	4,000	3,864,956	0.5
AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class D(a)	7.69%	04/15/2034	3,500	3,214,410	0.4
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class D(a)	7.94%	04/15/2034	3,000	2,824,155	0.3
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class E(a)	11.15%	04/15/2034	1,000	897,425	0.1
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class E(a)	10.96%	07/20/2034	3,250	2,890,537	0.4
AIG CLO LLC, Series 2021-3A, Class D(a)	7.92%	01/25/2035	3,000	2,756,160	0.3
AIG CLO Ltd., Series 2021-3A, Class E(a)	11.27%	01/25/2035	3,400	2,976,442	0.4
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class D(a)	7.46%	04/20/2034	3,500	3,235,281	0.4
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class E(a)	10.56%	04/20/2034	3,250	2,876,835	0.4
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2021-4A, Class D(a)	7.91%	10/20/2034	5,000	4,504,260	0.6
Ballyrock CLO 14 Ltd., Series 2020-14A, Class C(a)	8.41%	01/20/2034	2,000	1,878,954	0.2
Ballyrock CLO 14 Ltd., Series 2020-14A, Class D(a)	11.81%	01/20/2034	2,000	1,810,232	0.2
Ballyrock CLO 17 Ltd., Series 2021-17A, Class D(a)	10.79%	10/20/2034	2,000	1,719,544	0.2
Ballyrock CLO Ltd., Series 2018-1A, Class D(a)	10.61%	04/20/2031	1,000	853,916	0.1
Black Diamond CLO Ltd., Series 2016-1A, Class A2AR(a)	6.57%	04/26/2031	5,000	4,832,525	0.6
Black Diamond CLO Ltd., Series 2019-2A, Class B(a)	7.87%	07/23/2032	4,125	4,009,900	0.5
BlueMountain Fuji US CLO II Ltd.,					
Series 2017-2A, Class D(a)	10.96%	10/20/2030	1,000	828,987	0.1
Cedar Funding IX CLO Ltd., Series 2018-9A, Class E(a)	10.16%	04/20/2031	875	753,043	0.1
Dryden 64 CLO Ltd., Series 2018-64A, Class B(a)	6.19%	04/18/2031	3,800	3,714,268	0.5
Elmwood CLO 15 Ltd., Series 2022-2A, Class D(a)	8.32%	04/22/2035	4,000	3,838,560	0.5
Galaxy XXIII CLO Ltd., Series 2017-23A, Class B1R(a)	6.16%	04/24/2029	1,350	1,321,222	0.2
Goldentree Loan Management US CLO 7 Ltd.,					
Series 2020-7A, Class DR(a)	7.96%	04/20/2034	1,000	940,511	0.1
Goldentree Loan Opportunities XI Ltd.,					
Series 2015-11A, Class BR2(a)	6.14%	01/18/2031	8,000	7,871,992	1.0
Greywolf CLO VI Ltd., Series 2018-1A, Class A2(a)	6.56%	04/26/2031	5,000	4,934,245	0.6
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.,					
Series 2018-1A, Class C(a)	8.01%	07/21/2031	2,000	1,747,496	0.2
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class B(a)	6.34%	04/15/2034	3,000	2,922,804	0.4
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(a)	11.25%	04/15/2034	3,000	2,697,312	0.3
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class DR(a)	7.56%	10/20/2030	2,000	1,853,758	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 Ltd.,					
Series 2019-33A, Class DR(a)	7.69%	10/16/2033	1,875	1,759,384	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 Ltd.,					
Series 2020-39A, Class D(a)	8.41%	01/20/2032	1,250	1,192,784	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 Ltd., Series 2020-39A, Class E(a)	12.01%	01/20/2032	2,500	2,295,248	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 Ltd., Series 2021-42A, Class E(a)	10.74%	07/16/2035	USD 3,625	\$ 3,212,540	0.4%
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 43 Ltd., Series 2021-43A, Class D(a)	7.89%	07/17/2035	3,000	2,816,139	0.3
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 44 Ltd., Series 2021-44A, Class E(a)	10.79%	10/16/2034	1,500	1,329,645	0.2
New Mountain CLO 3 Ltd., Series CLO-3A, Class D(a)	8.16%	10/20/2034	5,000	4,497,670	0.5
OCP CLO Ltd., Series 2018-15A, Class D(a)	10.66%	07/20/2031	1,000	870,567	0.1
OZLM XXII Ltd., Series 2018-22A, Class D(a)	10.09%	01/17/2031	1,750	1,295,903	0.2
Peace Park CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(a)	10.81%	10/20/2034	2,830	2,502,331	0.3
Pikes Peak CLO 7, Series 2021-7A, Class D(a)	8.36%	02/25/2034	5,000	4,649,610	0.6
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class A(a)	5.98%	07/20/2034	10,000	9,827,320	1.2
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class D(a)	7.91%	07/20/2034	5,000	4,596,335	0.6
Pikes Peak CLO 10, Series 2022-10A, Class D(a)	8.48%	04/22/2034	4,000	3,778,288	0.5
PPM CLO 5 Ltd., Series 2021-5A, Class E(a)	11.29%	10/18/2034	1,400	1,173,740	0.1
PPM CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(a)	10.74%	07/15/2031	3,000	2,163,168	0.3
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2017-3A, Class B(a)	6.27%	10/20/2030	3,000	2,931,393	0.4
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2018-1A, Class D(a)	7.92%	05/20/2031	3,450	3,159,051	0.4
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2018-2A, Class B(a)	6.61%	10/20/2031	7,000	6,900,649	0.8
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(a)	11.17%	07/20/2034	3,000	2,585,424	0.3
TCW CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(a)	10.87%	04/25/2031	2,250	1,917,545	0.2
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class AR(a)	6.01%	07/20/2031	2,000	1,972,794	0.2
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class B1R(a)	6.56%	07/20/2031	5,000	4,832,605	0.6
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class CR(a)	7.16%	07/20/2031	2,000	1,891,150	0.2
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class DR(a)	8.31%	07/20/2031	4,000	3,506,704	0.4
TRESTLES CLO Ltd., Series 2018-2A, Class A2(a)	6.49%	07/25/2031	3,000	2,952,963	0.4
Venture XXVII CLO Ltd., Series 2017-27A, Class D(a)	8.81%	07/20/2030	1,500	1,313,049	0.2
Whehle Park CLO Ltd., Series 2022-1A, Class D(a)	8.00%	04/21/2035	3,000	2,765,403	0.3
				<u>163,259,132</u>	<u>20.1</u>
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2018	4.00%	10/01/2048	4,696	4,493,247	0.6
Federal National Mortgage Association, Series 2000	7.50%	10/01/2030	2	2,225	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.50%	06/01/2031	24	25,045	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2003	5.00%	11/01/2033	128	127,126	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2004	8.00%	09/01/2033	278	293,877	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2008	5.00%	07/01/2037	134	132,909	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2008	5.50%	05/01/2038	172	176,692	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2009	5.00%	05/01/2039	67	67,382	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	02/01/2040	421	422,136	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	04/01/2040	604	605,542	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	12/01/2040	579	580,989	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2011	5.00%	04/01/2041	284	284,746	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2014	5.00%	08/01/2044	609	619,500	0.1
Government National Mortgage Association, Series 2009	5.00%	10/15/2039	135	134,700	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2012	5.50%	06/15/2038	42	42,667	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2014	5.00%	08/20/2041	293	293,171	0.0
				<u>8,301,954</u>	<u>1.0</u>
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 15-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2011	5.00%	07/01/2025	12	11,902	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2011	6.50%	03/01/2026	1	1,354	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2012	5.00%	06/01/2026	0*	428	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2014	3.50%	02/01/2029	360	348,594	0.1
				<u>362,278</u>	<u>0.1</u>
				<u>8,664,232</u>	<u>1.1</u>
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
TGIF Funding LLC, Series 2017-1A, Class A2	6.20%	04/30/2047	5,208	4,850,795	0.6
AUTOS – FESTVERZINSLICH					
Octane Receivables Trust, Series 2022-1A, Class D	5.54%	02/20/2029	3,708	3,462,009	0.4
BAUSPARDARLEHEN – FESTVERZINSLICH					
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2005-WF1, Class A5	5.01%	11/25/2034	0*	3	0.0
				<u>8,312,807</u>	<u>1.0</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
FINANZEN					
Curo Group Holdings Corp.	7.50%	08/01/2028	5,323	2,240,331	0.3
Enova International, Inc.	8.50%	09/15/2025	1,002	961,503	0.1
				<u>3,201,834</u>	<u>0.4</u>
				<u>699,895,976</u>	<u>86.1</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I					
Series 2018-7, Class PT.	1.49%	06/15/2043	USD 10	\$ 8,930	0.0%
Series 2018-20, Class PT.	11.77%	11/16/2043	51	47,682	0.0
Series 2019-24, Class PT.	11.35%	08/15/2044	260	252,258	0.1
Series 2019-44, Class PT.	15.06%	11/15/2044	266	255,273	0.1
Consumer Loan Underlying Bond Club Certificate Issuer Trust I					
Series 2018-4, Class PT.	6.57%	05/15/2043	5	4,849	0.0
Series 2018-12, Class PT.	9.36%	06/15/2043	21	20,332	0.0
Series 2019-48, Class PT.	15.17%	12/15/2044	250	239,040	0.0
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust					
Series 2018-3, Class PT.			6,465	5,949	0.0
SMB Private Education Loan Trust					
Series 2021-A, Class R(e)	0.00%	01/15/2053	2	4,310,090	0.5
Series 2021-C, Class R(e)	0.00%	01/15/2053	14	6,750,000	0.8
Series 2022-A, Class R.	0.00%	11/16/2054	3	3,209,184	0.4
				<u>15,103,587</u>	<u>1.9</u>
AUTOS – FESTVERZINSLICH					
Octane Receivables Trust					
Series 2020-1A, Class R1(e)	0.00%	03/20/2028	9	877,509	0.1
Series 2021-1A, Class R1(e)	0.00%	11/20/2028	5	960,990	0.1
Santander Consumer Auto Receivables Trust					
Series 2021-BA, Class R(e)	0.00%	03/15/2029	5	883,943	0.1
Series 2021-CA, Class R(e)	0.00%	06/15/2028	6	650,987	0.1
				<u>3,373,429</u>	<u>0.4</u>
				<u>18,477,016</u>	<u>2.3</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2019-FTR2, Class B2(a)	12.02%	11/25/2048	1,000	999,409	0.1
Series 2019-FTR3, Class B2(a)	9.31%	09/25/2047	6,980	6,011,657	0.7
Series 2019-HQA1, Class B2(a)	16.87%	02/25/2049	750	878,602	0.1
JPMorgan Madison Avenue Securities Trust					
Series 2014-CH1, Class M2(a)	8.87%	11/25/2024	541	523,461	0.1
Series 2015-CH1, Class M2(a)	10.12%	10/25/2025	1,256	1,232,209	0.1
Wells Fargo Credit Risk Transfer Securities Trust,					
Series 2015-WF1, Class 1M2(a)	9.87%	11/25/2025	602	561,211	0.1
				<u>10,206,549</u>	<u>1.2</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
Grantor Trust COMM, Series 2014-UBS2(e)	0.00%	03/10/2047	14	256,624	0.0
Grantor Trust CSAIL, Series 2015-C1(e)	4.00%	04/15/2050	226	3,322,544	0.4
Grantor Trust JPMBB, Series 2014-C24(e)	4.00%	11/15/2047	210	1,170,472	0.1
Grantor Trust WFRBS, Series 2014-C23(e)	3.40%	10/15/2057	217	4,553,082	0.6
Morgan Stanley Capital I Trust,					
Series 2019-BPR, Class XCP(d)	0.00%	04/15/2023	163,600	1,636	0.0
				<u>9,304,358</u>	<u>1.1</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
Eaton Vance CLO Ltd., Series 2014-1RA, Class D(a)	7.84%	07/15/2030	1,500	1,398,664	0.2
STAMMAKTIEN					
Mt Logan Re Ltd. (Special Investment)(e)			924	933,168	0.1
Mt Logan Re Ltd. (Special Investment)(e)			632	445,576	0.1
				<u>1,378,744</u>	<u>0.2</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Virgolino de Oliveira Finance SA(e) (f)	10.88%	01/13/2020	1,665	167	0.0
				<u>40,765,498</u>	<u>5.0</u>

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Gesamtanlagen				
(Kosten \$908,420,334).....			\$ 740,661,474	91.1%
Termineinlagen				
ANZ, London(g)	2.09 %	-	220	0.0
BBH, Grand Cayman(g)	0.74 %	-	1	0.0
HSBC, Paris(g)	1.53 %	-	16	0.0
HSBC, Singapore(g)	2.56 %	-	13	0.0
SMBC, Tokyo(g)	3.93 %	-	51,694,076	6.3
Standard Chartered Bank, Johannesburg(g).....	5.62 %	-	15,141	0.0
Termineinlagen insgesamt			<u>51,709,467</u>	<u>6.3</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			<u>20,954,555</u>	<u>2.6</u>
Nettovermögen			<u>\$ 813,325,496</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CNH 166	USD 24	03/08/2023	\$ 364
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 9	USD 10	03/08/2023	63
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 1	CNH 5	03/08/2023	2
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 3,664	CNH 24,791	03/08/2023	(96,065)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 9,254	EUR 8,689	03/08/2023	(60,956)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CNH 166	USD 24	03/17/2023	363
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 10	USD 10	03/17/2023	64
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 1	CNH 5	03/17/2023	2
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 3,668	CNH 25,098	03/17/2023	(54,463)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 9,334	EUR 8,760	03/17/2023	(60,030)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	AUD 1,273	USD 868	03/24/2023	11,088
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	AUD 55	USD 37	03/24/2023	(8)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR 8	USD 9	03/24/2023	41
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	GBP 2	USD 2	03/24/2023	6
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD 14	USD 10	03/24/2023	67
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 25,048	AUD 36,724	03/24/2023	(315,621)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 9,286	EUR 8,730	03/24/2023	(39,934)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 107	GBP 89	03/24/2023	(554)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 716	SGD 958	03/24/2023	(4,952)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 9	ZAR 158	03/24/2023	28
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 5,842	ZAR 106,697	03/24/2023	(43,419)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR 5,612	USD 308	03/24/2023	3,008
				<u>\$ (660,906)</u>
			Wertsteigerung	\$ 15,096
			Wertminderung	\$ (676,002)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 25,200	04/25/2024	2.703%	1 Day SOFR	\$ 718,699
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 9,060	07/01/2024	3.132%	1 Day SOFR	243,053
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 14,760	04/25/2027	2.774%	1 Day SOFR	758,093
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 11,380	07/01/2027	2.937%	1 Day SOFR	520,128
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 12,630	10/04/2027	3.737%	1 Day SOFR	165,670
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 12,570	10/11/2027	3.795%	1 Day SOFR	133,314
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 17,100	11/10/2027	4.092%	1 Day SOFR	(39,770)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 3,370	04/25/2032	2.719%	1 Day SOFR	247,045
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 2,040	07/01/2032	2.914%	1 Day SOFR	120,747
Insgesamt					<u>\$ 2,866,979</u>
				Wertsteigerung	\$ 2,906,749
				Wertminderung	\$ (39,770)

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Verkaufskontrakte						
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,148	\$ (223,613)	\$ (131,308)	\$ (92,305)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,722	(335,420)	(173,803)	(161,617)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 461	(89,893)	(34,496)	(55,397)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,148	(223,613)	(146,192)	(77,421)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,435	(279,516)	(74,958)	(204,559)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,435	(279,517)	(82,840)	(196,676)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,181	(229,986)	(144,621)	(85,365)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,435	(279,516)	(146,862)	(132,654)
Insgesamt				<u>\$ (1,941,074)</u>	<u>\$ (935,080)</u>	<u>\$ (1,005,994)</u>
Swaps insgesamt						<u>\$ 1,860,985</u>

* Kapitalbetrag geringer als 500.

- (a) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 28. Februar 2023.
- (b) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 28. Februar 2023.
- (c) Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (d) Kredit, bei dem bis zur Endfälligkeit nur Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (e) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (f) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (g) Tagesgeld.

Währungskürzel:

- AUD – Australian Dollar
- CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
- EUR – Euro
- GBP – Great British Pound
- SGD – Singapore Dollar
- USD – United States Dollar
- ZAR – South African Rand

Glossar:

- ABS – Asset-Backed Securities
- CDX-CMBX.NA – North American Commercial Mortgage-Backed Index
- CLO – Collateralized Loan Obligations
- CMBS – Commercial Mortgage-Backed Securities
- CME – Chicago Mercantile Exchange
- LCH – London Clearing House
- REMICs – Real Estate Mortgage Investment Conduits
- SOFR – Secured Overnight Financing Rate

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

ZUSAMMENSETZUNG DES FONDSVERMÖGENS

28. Februar 2023

AB FCPI

	Dynamic Diversified Portfolio (USD)	Global Equity Blend Portfolio (USD)	Global Value Portfolio (USD)
VERMÖGENSWERTE			
Anlagen in Wertpapiere zum Wert	\$ 33,700,117	\$ 89,755,061	\$ 630,007,987
Dividenden- und Zinsforderungen	111,209	88,812	917,790
Termineinlagen	931,158	3,460,446	10,860,734
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel	458,009	490,807	1,044,928
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital	4,558	27,504	2,860,896
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps	100,121	-0-	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften	212,383	281,309	2,973,055
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren	67,511	184,912	678
Zinsforderungen aus Swaps	11,685	-0-	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten	43,438	-0-	-0-
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren	36,298	-0-	-0-
Forderungen aus der Wertpapierleihe	-0-	2,009	26,765
Sonstige Forderungen	-0-	-0-	-0-
	<u>35,676,487</u>	<u>94,290,860</u>	<u>648,692,833</u>
VERBINDLICHKEITEN			
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere	925,687	519,704	-0-
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren	34,453	-0-	-0-
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar	103,738	44,737	615,263
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften	74,636	251,698	779,414
Zu zahlende Dividenden	-0-	-0-	650,047
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps	178,516	-0-	-0-
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital	14,157	135,024	364,910
Unrealisierte Wertminderung aus Finanzterminkontrakten	58,057	-0-	-0-
Zinsaufwand für Swaps	15,288	-0-	-0-
Verkaufte Optionen, zum Marktwert	-0-	-0-	-0-
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten	236,382	198,448	744,978
	<u>1,640,914</u>	<u>1,149,611</u>	<u>3,154,612</u>
NETTOVERMÖGEN	<u>\$ 34,035,573</u>	<u>\$ 93,141,249</u>	<u>\$ 645,538,221</u>

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

Emerging Markets Growth Portfolio (USD)	Asia Ex-Japan Equity Portfolio (USD)	Japan Strategic Value Portfolio (JPY)	China Low Volatility Equity Portfolio (USD)	Short Duration Bond Portfolio (USD)	Global High Yield Portfolio (USD)	American Income Portfolio (USD)
\$ 614,593,272	\$ 362,808,822	¥ 6,243,558,206	\$ 119,329,786	\$ 471,254,403	\$ 13,879,465,332	\$ 18,642,935,825
339,265	1,059,061	11,406,212	-0-	4,363,236	217,345,175	268,578,752
7,914,048	5,643,285	96,626,810	7,091,291	7,330,089	176,815,879	162,890,308
545,499	-0-	-0-	52,730	6,608,943	92,103,796	174,803,836
1,001,001	3,529,785	226,196	30,010	591,014	63,948,724	159,575,940
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	103,129,899	83,643,194
3,468	18,897	8,218,183	9,763	5,253,992	60,721,247	56,236,946
1,988,027	2,912,870	314,404,969	12	2,247,548	10,215,657	14,812,722
-0-	-0-	-0-	-0-	158,212	17,438,495	17,028,819
-0-	-0-	-0-	-0-	1,089,603	196,148	3,016
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	55,351	682
16	501	94,683	614	-0-	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
<u>626,384,596</u>	<u>375,973,221</u>	<u>6,674,535,259</u>	<u>126,514,206</u>	<u>498,897,040</u>	<u>14,621,435,703</u>	<u>19,580,510,040</u>
757	2,319,663	2,962,724	59,050	7,112,251	37,636,892	501,329,819
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	165,863,338	102,338,225
-0-	1,304,433	63,397	-0-	1,253,685	117,979,832	100,218,993
63,044	465,965	603,921	265,354	2,057,019	111,768,181	93,565,902
3,762	497,507	6,338,870	146,118	651,503	89,524,755	73,654,906
-0-	-0-	-0-	-0-	940,803	54,463,349	93,861,314
1,462,159	3,659,023	326,813,583	2,307,612	1,587,149	17,704,158	89,348,330
-0-	-0-	-0-	-0-	268,203	4,254,867	11,477,650
-0-	-0-	-0-	-0-	64,713	-0-	4,775,730
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
<u>1,146,869</u>	<u>1,144,483</u>	<u>58,906,836</u>	<u>370,343</u>	<u>805,160</u>	<u>25,355,159</u>	<u>22,476,815</u>
<u>2,676,591</u>	<u>9,391,074</u>	<u>395,689,331</u>	<u>3,148,477</u>	<u>14,740,486</u>	<u>624,550,531</u>	<u>1,093,047,684</u>
<u>\$ 623,708,005</u>	<u>\$ 366,582,147</u>	<u>¥ 6,278,845,928</u>	<u>\$ 123,365,729</u>	<u>\$ 484,156,554</u>	<u>\$ 13,996,885,172</u>	<u>\$ 18,487,462,356</u>

ZUSAMMENSETZUNG DES FONDSVERMÖGENS (Fortsetzung)

28. Februar 2023

AB FCPI

	European Income Portfolio (EUR)	Emerging Markets Debt Portfolio (USD)	Mortgage Income Portfolio (USD)
VERMÖGENSWERTE			
Anlagen in Wertpapiere zum Wert	€ 1,196,798,368	\$ 473,600,167	\$ 740,661,474
Dividenden- und Zinsforderungen	18,195,164	7,763,821	8,049,039
Termineinlagen	20,854,232	4,462,035	51,709,467
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel	27,385,518	6,214,291	5,504,196
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital	5,079,182	1,191,666	22,309,150
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps	-0-	291,054	2,906,749
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften	9,902,471	1,094,960	15,096
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren	1,243	5,416,434	865,756
Zinsforderungen aus Swaps	-0-	64,059	2,126,429
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten	4,625,906	5,493	-0-
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren	-0-	15,650	-0-
Forderungen aus der Wertpapierleihe	-0-	0-	-0-
Sonstige Forderungen	-0-	-0-	52,585
	<u>1,282,842,084</u>	<u>500,119,630</u>	<u>834,199,941</u>
VERBINDLICHKEITEN			
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere	11,194,897	2,694,675	3,082,834
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren	1,487,957	1,456,650	937,124
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar	933,323	320,000	8,664,064
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften	1,200,092	2,388,114	676,002
Zu zahlende Dividenden	4,664,968	1,712,793	2,495,730
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps	88,755	12,962	1,045,764
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital	2,069,564	292,761	793,020
Unrealisierte Wertminderung aus Finanzterminkontrakten	16,039,400	19,899	-0-
Zinsaufwand für Swaps	468,601	25,431	2,071,835
Verkaufte Optionen, zum Marktwert	-0-	699,788	-0-
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten	2,933,799	993,919	1,108,072
	<u>41,081,356</u>	<u>10,616,992</u>	<u>20,874,445</u>
NETTOVERMÖGEN	<u>€ 1,241,760,728</u>	<u>\$ 489,502,638</u>	<u>\$ 813,325,496</u>

* Die Anlagetätigkeit innerhalb des American Income Portfolio in Bezug auf dessen Anlage in das Emerging Markets Debt Portfolio wurde im Rahmen des konsolidierten Abschlusses zu Darstellungszwecken nicht berücksichtigt.

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

**Kombiniert
(USD)**

\$ 37,325,038,752*
527,649,379*
461,871,637
316,792,697
260,444,150
190,071,017
137,354,952
41,008,598
36,827,699
6,230,519
107,981
30,596
52,585
<u>39,303,480,562*</u>
567,543,803
272,203,602
231,492,384
213,629,075
174,022,460*
150,596,584
122,243,020
33,043,549
7,448,636
699,788
58,113,727
<u>1,831,036,628*</u>
<u>\$ 37,472,443,934*</u>

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND VERÄNDERUNG DES FONDSVERMÖGENS

Für den Zeitraum zum 28. Februar 2023

AB FCPI

	Dynamic Diversified Portfolio (USD)	Global Equity Blend Portfolio (USD)	Global Value Portfolio (USD)
ANLAGEERTRÄGE			
Zinsen	\$ 190,851	\$ 46,224	\$ 152,570
Swap-Erträge	10,121	-0-	-0-
Dividenden, netto	121,127	530,408	5,212,352
Erträge aus der Wertpapierleihe, netto	-0-	13,925	177,666
	<u>322,099</u>	<u>590,557</u>	<u>5,542,588</u>
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgebühr	213,716	370,877	2,234,988
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	16,495	15,020	129,505
Aufwendungen für Swaps	40,332	-0-	-0-
Transferstelle	18,529	19,346	85,932
Steuern	7,871	8,718	71,224
Vertriebsgebühr	3,772	2,543	600
Gebühr für professionelle Dienstleistungen	58,075	51,053	97,471
Depotbankgebühren	74,701	16,534	88,582
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr	13,304	17,001	46,103
Druckkosten	437	370	5,750
Sonstige Aufwendungen	25,633	17,234	27,706
	<u>472,865</u>	<u>518,696</u>	<u>2,787,861</u>
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen	(144,046)	(53,182)	(7)
Nettoaufwendungen	328,819	465,514	2,787,854
Netto-Anlageertrag/(-verlust)	<u>(6,720)</u>	<u>125,043</u>	<u>2,754,734</u>
REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen	(1,739,725)	(3,495,213)	(40,712,098)
Kapitalertragsteuer	-0-	(5,900)	-0-
ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen	1,801,544	7,870,054	77,711,310
Aus Finanzterminkontrakten	(17,980)	-0-	-0-
Aus Devisentermingeschäften	(10,698)	(102,105)	645,518
Aus Swaps	24,920	-0-	-0-
Aus verkauften Optionen	-0-	-0-	-0-
Ergebnis der Geschäftstätigkeit	<u>51,341</u>	<u>4,391,879</u>	<u>40,399,464</u>
EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN			
Steigerung/(Minderung)	(1,410,445)	(3,401,777)	(54,902,609)
Ausschüttungen	-0-	-0-	(3,746,204)
NETTOVERMÖGEN			
Beginn des Berichtszeitraums	35,394,677	92,151,147	663,787,570
Anpassung aus Währungsumrechnung	-0-	-0-	-0-
Ende des Berichtszeitraums	<u>\$ 34,035,573</u>	<u>\$ 93,141,249</u>	<u>\$ 645,538,221</u>

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

Emerging Markets Growth Portfolio (USD)	Asia Ex-Japan Equity Portfolio (USD)	Japan Strategic Value Portfolio (JPY)	China Low Volatility Equity Portfolio (USD)	Short Duration Bond Portfolio (USD)	Global High Yield Portfolio (USD)	American Income Portfolio (USD)
\$ 215,623	\$ 47,042	¥ 152	\$ 71,843	\$ 9,166,685	\$ 515,246,023	\$ 492,633,697
-0-	-0-	-0-	-0-	259,175	66,554,518	63,883,776
2,289,531	2,939,006	70,770,320	541,675	-0-	14,401,922	15,201,281
11,567	8,292	814,119	1,651	-0-	-0-	-0-
2,516,721	2,994,340	71,584,591	615,169	9,425,860	596,202,463	571,718,754
4,224,695	1,991,265	27,769,282	724,888	1,436,950	92,547,106	80,638,559
240,178	59,603	895,504	20,182	195,267	6,119,189	7,260,054
-0-	-0-	-0-	-0-	385,142	368,822	7,368,699
136,715	91,239	2,013,410	41,220	125,944	3,941,796	3,849,732
117,909	49,711	815,594	19,349	101,658	2,935,448	3,635,795
7,917	60,028	-0-	2,511	257	4,229,612	2,654,613
122,380	122,419	15,187,693	52,382	167,219	484,378	522,057
109,612	112,171	3,119,531	26,823	73,831	491,981	424,660
43,900	33,051	1,943,964	18,789	40,114	201,113	201,113
7,124	14,675	679,981	2,465	16,433	104,147	121,632
55,518	50,585	5,091,049	28,512	93,027	380,787	534,747
5,065,948	2,584,747	57,516,008	937,121	2,635,842	111,804,379	107,211,661
-0-	(11,043)	(23,814,055)	(66,413)	(83,379)	-0-	(31)
5,065,948	2,573,704	33,701,953	870,708	2,552,463	111,804,379	107,211,630
(2,549,227)	420,636	37,882,638	(255,539)	6,873,397	484,398,084	464,507,124
(55,384,393)	(71,199,949)	160,157,365	(17,457,328)	(21,400,521)	(647,861,909)	(513,454,063)
0	55,507	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
50,017,111	45,360,111	8,694,843	12,864,691	17,736,918	266,125,199	(204,569,914)
-0-	-0-	-0-	-0-	(56,709)	(420,739)	8,390,300
(50,259)	(116,909)	(41,620,125)	121,238	(1,709,337)	(25,559,576)	(21,372,718)
-0-	-0-	-0-	-0-	(216,838)	263,497,256	173,411,152
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
(7,966,768)	(25,480,604)	165,114,721	(4,726,938)	1,226,910	340,178,315	(93,088,119)
85,596,237	(100,269,211)	(542,460,403)	7,663,972	7,145,700	(228,209,300)	2,414,313,900
(20,047)	(3,008,516)	(39,891,754)	(971,150)	(3,790,854)	(536,441,205)	(400,479,510)
546,098,583	495,340,478	6,696,083,364	121,399,845	479,574,798	14,421,357,362	16,566,716,085
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
<u>\$ 623,708,005</u>	<u>\$ 366,582,147</u>	<u>¥ 6,278,845,928</u>	<u>\$ 123,365,729</u>	<u>\$ 484,156,554</u>	<u>\$ 13,996,885,172</u>	<u>\$ 18,487,462,356</u>

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND VERÄNDERUNG DES FONDSVERMÖGENS

(Fortsetzung)

Für den Zeitraum zum 28. Februar 2023

AB FCPI

	European Income Portfolio (EUR)	Emerging Markets Debt Portfolio (USD)	Mortgage Income Portfolio (USD)
ANLAGEERTRÄGE			
Zinsen	€ 33,224,397	\$ 17,671,438	\$ 35,340,551
Swap-Erträge	327,962	93,793	2,082,366
Dividenden, netto	-0-	-0-	-0-
Erträge aus der Wertpapierleihe, netto	-0-	-0-	-0-
	<u>33,552,359</u>	<u>17,765,231</u>	<u>37,422,917</u>
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgebühr	5,592,574	1,812,292	3,260,778
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	513,839	88,023	155,639
Aufwendungen für Swaps	240,700	142,819	1,559,581
Transferstelle	244,460	134,566	195,293
Steuern	249,314	85,095	154,947
Vertriebsgebühr	3,667	48,856	766
Gebühr für professionelle Dienstleistungen	156,704	141,256	153,701
Depotbankgebühren	180,088	63,168	84,994
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr	73,955	39,033	55,598
Druckkosten	7,670	2,903	8,310
Sonstige Aufwendungen	81,683	49,648	62,790
	<u>7,344,654</u>	<u>2,607,659</u>	<u>5,692,397</u>
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen	(29)	(235)	(1,848)
Nettoaufwendungen	<u>7,344,625</u>	<u>2,607,424</u>	<u>5,690,549</u>
Netto-Anlageertrag/(-verlust)	<u>26,207,734</u>	<u>15,157,807</u>	<u>31,732,368</u>
REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen	(125,195,820)	(29,569,977)	(24,092,724)
Kapitalertragsteuer	-0-	(8,553)	-0-
ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen	68,974,278	25,621,468	4,699,537
Aus Finanzterminkontrakten	(13,554,595)	72,242	-0-
Aus Devisentermingeschäften	4,483,658	(1,673,660)	905,223
Aus Swaps	912,040	209,737	4,994,758
Aus verkauften Optionen	-0-	(163,604)	44,715
Ergebnis der Geschäftstätigkeit	<u>(38,172,705)</u>	<u>9,645,460</u>	<u>18,283,877</u>
EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN			
Steigerung/(Minderung)	(100,856,537)	(12,231,594)	(20,697,681)
Ausschüttungen	(30,286,531)	(10,423,110)	(13,973,996)
NETTOVERMÖGEN			
Beginn des Berichtszeitraums	1,411,076,501	502,511,882	829,713,296
Anpassung aus Währungsumrechnung	-0-	-0-	-0-
Ende des Berichtszeitraums	<u>€ 1,241,760,728</u>	<u>\$ 489,502,638</u>	<u>\$ 813,325,496</u>

* Die Anlagetätigkeit innerhalb des American Income Portfolio in Bezug auf dessen Anlage in das Emerging Markets Debt Portfolio wurde im Rahmen des konsolidierten Abschlusses zu Darstellungszwecken nicht berücksichtigt.

Siehe Anmerkungen zum Halbjahresabschluss.

**Kombiniert
(USD)**

\$ 1,105,168,192
133,228,567
40,005,412*
218,963
<u>1,278,621,134*</u>
195,441,481
14,836,661
10,119,504
8,907,529
7,451,334
7,015,264
2,266,826
1,775,585
799,526
304,721
1,464,388
<u>250,382,819</u>
<u>(531,675)</u>
249,851,144
<u>1,028,769,990*</u>
(1,556,476,170)
41,054
378,434,682*
-6,006,123
-44,716,411
443,076,749
<u>(118,889)</u>
243,004,882*
1,971,956,595*
<u>(1,002,743,103)*</u>
36,189,382,182
70,843,378*
<u>\$ 37,472,443,934*</u>

KLASSE	Dynamic Diversified Portfolio	Global Equity Blend Portfolio	Global Value Portfolio
A	212,579	483,476	2,494,398
A EUR	23,110	20,133	251,524
A EUR H	33,536	181,601	-0-
A SGD	-0-	65,101	3,965,842
A SGD H	-0-	-0-	402,572
AD	-0-	-0-	1,266,031
AD AUD H	-0-	-0-	581,693
AD CAD H	-0-	-0-	304,346
AD EUR H	-0-	-0-	88,059
AD GBP H	-0-	-0-	209,959
AD HKD	-0-	-0-	684,913
AD ZAR H	-0-	-0-	908,018
AX	459,909	-0-	-0-
AX EUR	1,701	-0-	-0-
AX SGD	10,772	-0-	-0-
B	-0-	18,297	7,977
B SGD	-0-	6,341	-0-
BX	31,126	-0-	-0-
C	92,952	148,178	178,545
C EUR	3,225	107	4,440
C EUR H	49	-0-	-0-
CX	57,651	-0-	-0-
I	486,924	61,726	2,419,618
I EUR	22,986	22,436	456
I EUR H	105,175	-0-	-0-
I GBP	-0-	-0-	528
I SGD	-0-	-0-	241,343
IX	1,609	-0-	-0-
S	-0-	-0-	2,131,647
S GBP	-0-	-0-	3,405
S GBP H	-0-	-0-	428,366
S HKD	-0-	419,387	-0-
S1	-0-	229,930	8,877,977
S1 AUD H	-0-	-0-	122,534
S1 EUR	-0-	272	360
S1 GBP	-0-	277	5,152
S1 SGD	-0-	1,543,162	-0-
SD	-0-	-0-	1,162,335

KLASSE	Emerging Markets Growth Portfolio	Asia Ex-Japan Equity Portfolio	Japan Strategic Value Portfolio
A	9,968,641	657,305	43,499
A AUD H	146,864	253,722	-0-
A CZK H	-0-	-0-	397
A EUR	142,153	4,430,752	1,766
A EUR H	-0-	-0-	28,215
A HKD	11,255	65,184	-0-
A PLN	-0-	-0-	90
A PLN H	8,039	-0-	-0-
A SGD	1,467	-0-	470
A SGD H	2,373	3,953	1,164
A USD	-0-	-0-	13,800
A USD H	-0-	-0-	97,681
AD	37,568	1,852,904	11,650
AD AUD H	-0-	2,464,112	249,133
AD CAD H	-0-	536,341	-0-
AD EUR	-0-	50,262	-0-
AD EUR H	-0-	30,132	-0-
AD GBP H	-0-	328,511	-0-
AD HKD	-0-	931,578	-0-
AD NZD H	-0-	542,481	37,014
AD RMB H	-0-	1,060	-0-
AD USD H	-0-	-0-	52,194
AD ZAR H	-0-	2,063,084	43,417
AY JPY	-0-	116,752,118	-0-
B	14,824	-0-	-0-
BY JPY	-0-	940,230,001	-0-
C	195,898	2,552	232
C EUR	2,962	2,459	147
C EUR H	-0-	-0-	521
C USD	-0-	-0-	500
ED	80,191	193,584	-0-
ED AUD H	-0-	4,492	-0-
I	828,858	631,081	359
I AUD H	217,611	761	-0-
I EUR	72,027	40,532	11,587
I EUR H	-0-	-0-	367
I GBP	-0-	55,383	-0-
I SGD	-0-	-0-	100
I USD	-0-	-0-	13,273
I USD H	-0-	-0-	15,653
N	8,424	-0-	-0-
S	-0-	530,928	-0-
S EUR H	-0-	-0-	421
S HKD	-0-	402,147	-0-
S1	2,654,073	2,714,362	-0-
S1 EUR	128	311	74
S1 GBP	131	-0-	-0-
S1 USD	-0-	-0-	184,213
SD	-0-	472,978	82,187

UMLAUFE NDE ANTEILE (Fortsetzung)

28. Februar 2023

AB FCPI

KLASSE	China Low Volatility Equity Portfolio	Short Duration Bond Portfolio	Global High Yield Portfolio
A	617,969	3,666,092	128,461,010
A EUR	23,623	64,470	1,004,157
A HKD	31,223	-0-	-0-
A PLN H	29,928	-0-	-0-
A2	-0-	8,645,654	40,522,955
A2 CHF H	-0-	-0-	584,431
A2 EUR	-0-	86,860	638,547
A2 EUR H	-0-	4,181	1,809,262
A2 HKD	-0-	35,187	390,623
A2 PLN H	-0-	-0-	371,159
A2 SGD	-0-	-0-	4,150
A2 SGD H	-0-	-0-	694,525
AA	-0-	363,377	327,580,826
AA AUD H	-0-	865,201	143,470,465
AA CAD H	-0-	410,402	1,249,627
AA EUR H	-0-	-0-	2,008,139
AA GBP H	-0-	229,295	5,043,814
AA HKD	-0-	390,628	12,555,412
AA NZD H	-0-	-0-	2,233,318
AA RMB H	-0-	-0-	4,560,633
AA SGD H	-0-	37,338	1,768,134
AA ZAR H	-0-	-0-	243,435,376
AD	571,781	-0-	-0-
AD AUD H	1,288,085	-0-	-0-
AD CAD H	80,648	-0-	-0-
AD EUR H	20,285	-0-	-0-
AD GBP H	51,086	-0-	-0-
AD HKD	206,554	-0-	-0-
AD NZD H	147,558	-0-	-0-
AD SGD H	6,837	-0-	-0-
AD ZAR H	3,445,008	-0-	-0-
AJ	-0-	3,805,627	-0-
AK	-0-	-0-	14,547
AK EUR	-0-	-0-	110,555
AK EUR H	-0-	-0-	3,412
AR EUR H	-0-	-0-	26,634
AT	-0-	5,813,663	1,323,798,849
AT AUD H	-0-	295,352	74,095,061
AT CAD H	-0-	56,262	7,737,842
AT EUR	-0-	101,285	8,745,235
AT EUR H	-0-	9,451	5,446,112
AT GBP H	-0-	81,510	3,852,662
AT HKD	-0-	183,022	91,736,015
AT NZD H	-0-	59,979	10,958,140
AT RMB H	-0-	-0-	2,279,823
AT SGD	-0-	-0-	3,275,890
AT SGD H	-0-	26,687	18,630,642
AX	-0-	15,666	-0-
B	13,041	7,362	804,923
B EUR	282	-0-	-0-
B2	-0-	-0-	5,915
BT	-0-	-0-	302,953
BT AUD H	-0-	-0-	12,484
C	6,258	231,252	17,564,868
C EUR	2,772	-0-	12,857
C2	-0-	329,273	1,216,682
C2 EUR	-0-	-0-	5,259
C2 EUR H	-0-	457	10,373

KLASSE	China Low Volatility Equity Portfolio	Short Duration Bond Portfolio	Global High Yield Portfolio
CK.....	-0-	-0-	1,135
CK EUR H.....	-0-	-0-	756
CT.....	-0-	-0-	19,083
EA.....	-0-	-0-	156,864,557
EA AUD H.....	-0-	-0-	10,237,743
EA ZAR H.....	-0-	-0-	22,684,343
I.....	42,848	3,223,555	19,636,098
I EUR.....	292	1,313	75,188
I2.....	-0-	3,860,623	10,369,777
I2 AUD H.....	-0-	-0-	4,448
I2 CHF H.....	-0-	-0-	57,572
I2 EUR.....	-0-	717	31,418
I2 EUR H.....	-0-	335,606	874,342
I2 SGD.....	-0-	-0-	31,721
I2 SGD H.....	-0-	-0-	28,547
IA AUD H.....	-0-	-0-	230,440
IQD.....	-0-	-0-	20,184
IT.....	-0-	169,736	3,579,548
IT AUD H.....	-0-	-0-	742,067
IT CAD H.....	-0-	-0-	67,723
IT EUR H.....	-0-	-0-	20,086
IT GBP H.....	-0-	-0-	116,269
IT HKD.....	-0-	-0-	31,579
IT RMB H.....	-0-	-0-	11,656
J.....	-0-	-0-	4,547,420
N2.....	-0-	333,661	387,090
NT.....	-0-	86,336	1,614,862
S.....	225,329	790,154	-0-
S1.....	582,135	-0-	15,750,696
S1 2.....	-0-	2,090,480	-0-
S1 2 EUR.....	-0-	567	-0-
S1 EUR.....	98	-0-	320
S1D.....	-0-	-0-	29,278,305
S1D2.....	-0-	-0-	128,635
SA.....	-0-	130,703	635,209
SHK.....	-0-	-0-	193,512
SK.....	-0-	-0-	10,548,430
W.....	-0-	-0-	90,399
W EUR.....	-0-	-0-	740
W2.....	-0-	-0-	88,774
W2 CHF H.....	-0-	-0-	7,008
W2 EUR H.....	-0-	-0-	15,731
WT.....	-0-	-0-	146,146
WT AUD H.....	-0-	-0-	164,509
WT CAD H.....	-0-	-0-	163,423
WT EUR H.....	-0-	-0-	223,325
WT GBP H.....	-0-	-0-	14,677
WT RMB H.....	-0-	-0-	37,057

UMLAUFENDE ANTEILE (Fortsetzung)

28. Februar 2023

AB FCPI

KLASSE	American Income Portfolio	European Income Portfolio	Emerging Markets Debt Portfolio
A	156,471,878	1,984,836	918,709
A EUR	626,304	-0-	571
A USD	-0-	418,371	-0-
A2	57,089,998	2,492,432	411,363
A2 CHF H	655,579	8,545	729
A2 DUR PH	3,867	-0-	-0-
A2 EUR	1,159,518	-0-	158,179
A2 EUR H	2,232,002	-0-	19,155
A2 HKD	795,776	-0-	9,024
A2 PLN	-0-	-0-	2,760
A2 PLN H	612,864	2,042	64,113
A2 SGD	10,048	-0-	-0-
A2 SGD H	878,044	-0-	228,090
A2 USD	-0-	313,074	-0-
A2 USD H	-0-	365,010	-0-
AA	114,781,950	1,836,986	3,699,767
AA AUD H	38,943,946	8,069,975	2,598,765
AA CAD H	4,672,156	-0-	6,442
AA DUR PH	482,480	-0-	-0-
AA EUR H	2,477,666	-0-	1,218
AA GBP H	10,253,190	-0-	15,150
AA HKD	46,458,740	-0-	165,733
AA HKD H	-0-	3,805,569	-0-
AA NZD H	5,033,640	-0-	44,729
AA RMB H	10,668,738	577,860	1,266
AA SGD H	2,494,202	78,349	1,487
AA USD H	-0-	36,828,019	-0-
AA ZAR H	18,047,687	-0-	7,214,852
AI	-0-	-0-	15,483
AI AUD H	-0-	-0-	1,091
AK	34,027	97,948	-0-
AK EUR	31,687	-0-	-0-
AK EUR H	21,303	-0-	-0-
AR	-0-	2,625,105	-0-
AR EUR	5,941	-0-	800
AR EUR H	12,731	-0-	-0-
AT	774,063,080	12,956,208	6,240,088
AT AUD H	86,580,426	3,841,597	4,386,572
AT CAD H	25,753,442	-0-	122,547
AT DUR PH	38,900	-0-	-0-
AT EUR	5,463,560	-0-	35,490
AT EUR H	10,060,788	-0-	229,912
AT GBP H	19,139,088	-0-	32,743
AT HKD	253,828,987	-0-	535,635
AT NZD H	12,733,147	-0-	408,209
AT RMB H	4,995,042	-0-	-0-
AT SGD	1,394,188	-0-	-0-
AT SGD H	31,549,799	581,898	225,993
AT USD	-0-	538,177	-0-
AT USD H	-0-	11,936,532	-0-
B	582,824	-0-	-0-
B USD	-0-	106,897	-0-
B2	35,845	680	-0-
B2 USD	-0-	1,300	-0-
BT	613,545	-0-	18,790
C	21,606,550	652,758	208,930
C EUR	11,325	-0-	616
C USD	-0-	118,082	-0-
C2	5,521,849	46,836	84,891
C2 DUR PH	4,260	-0-	-0-
C2 EUR	61,178	-0-	843
C2 EUR H	62,865	-0-	-0-
C2 EUR H	-0-	-0-	541
C2 USD	-0-	9,584	-0-

KLASSE	American Income Portfolio	European Income Portfolio	Emerging Markets Debt Portfolio
C2 USD H	-0-	132,492	-0-
CK	-0-	8,435	-0-
CT	154,485	-0-	1,105
CT USD H	-0-	41,176	-0-
EA	42,364,151	-0-	771,350
EA AUD H	4,321,234	-0-	160,241
EA ZAR H	5,173,113	-0-	353,615
EI	-0-	-0-	168,587
EI AUD H	-0-	-0-	8,615
I	46,051,937	698,963	353,418
I EUR	50,534	-0-	-0-
I USD	-0-	639,182	-0-
I2	51,950,230	9,134,253	87,075
I2 AUD H	3,339,487	186,191	267,818
I2 CHF H	306,151	633	600
I2 DUR PH	1,900	-0-	-0-
I2 EUR	3,165,703	-0-	391,425
I2 EUR H	1,416,875	-0-	3,747,832
I2 HKD	135,766	-0-	-0-
I2 SGD	498	-0-	-0-
I2 SGD H	219,640	-0-	-0-
I2 USD	-0-	24,735	-0-
I2 USD H	-0-	179,265	-0-
IA	404,847	76,812	-0-
IA AUD H	3,383,660	-0-	-0-
IA HKD H	-0-	1,233	-0-
IA SGD H	-0-	1,490	-0-
IA USD H	-0-	19,138	-0-
IT	15,751,259	91,232	-0-
IT AUD H	367,964	-0-	1,316
IT CAD H	483,238	-0-	-0-
IT EUR H	91,261	-0-	1,333,333
IT GBP H	231,381	-0-	-0-
IT HKD	57,559	-0-	-0-
IT JPY	279,497	-0-	-0-
IT JPY H	283,589	-0-	-0-
IT NZD H	20,929	-0-	-0-
IT RMB H	50,667	-0-	-0-
IT SGD	31,898	-0-	-0-
IT SGD H	1,800,989	1,402	-0-
IT USD H	-0-	132,427	-0-
J	74,622,918	-0-	-0-
L2	3,333	-0-	-0-
LT	4,009	-0-	-0-
N2	3,909,234	-0-	11,250
NT	2,469,212	-0-	68,699
NT USD H	-0-	54,916	-0-
S	1,600,713	-0-	275
S1	54,355,991	255,797	-0-
S1 2	-0-	-0-	3,436,708
S1 2 EUR	-0-	-0-	266
S1 EUR H	-0-	-0-	521
S1 GBPH	-0-	-0-	431
S1 USD	-0-	349	-0-
S1 USD H	-0-	7,061,210	-0-
S1D	29,079,602	807,125	-0-
S1D2	480,374	-0-	-0-
SA	4,052,331	-0-	890,507
SA USD H	-0-	895,033	-0-
SHK	1,567,292	79,865	-0-
W	1,768,474	-0-	-0-
W2	5,139,896	912,620	-0-
W2 CHF H	125,257	146,001	-0-
W2 EUR H	282,572	-0-	-0-
W2 USD H	-0-	4,667	-0-

UMLAUFENDE ANTEILE (Fortsetzung)

28. Februar 2023

AB FCPI

	American Income Portfolio	European Income Portfolio	Emerging Markets Debt Portfolio
KLASSE			
WA.....	-0-	505,138	-0-
WA HKD H.....	-0-	981	-0-
WA USD H.....	-0-	589,240	-0-
WT.....	4,476,485	102,929	-0-
WT AUD H.....	673,295	-0-	-0-
WT EUR H.....	377,025	-0-	-0-
WT GBP H.....	194,640	-0-	-0-
WT HKD.....	559,336	-0-	-0-
WT SGD H.....	774,560	1,117	-0-
WT USD H.....	-0-	4,180	-0-
			Mortgage Income Portfolio
KLASSE			
A.....			8,108,613
A2.....			5,052,036
A2 EUR.....			78,661
A2 HKD.....			4,115
A2 SGD.....			565
A2X.....			250,291
A2X EUR.....			35,684
AA.....			7,738,394
AA AUD H.....			2,935,291
AA HKD.....			3,964,808
AA RMB H.....			744,489
AA SGD H.....			66,500
AA ZAR H.....			1,546,170
AR EUR H.....			7,101
AT.....			2,190,210
AT AUD H.....			543,621
AT EUR.....			19,909
AT GBP H.....			7,515
AT HKD.....			79,643
AT SGD.....			867
AT SGD H.....			27,521
AX.....			459,905
AX EUR.....			3,753
BX.....			60,796
BX EUR.....			3,298
C.....			1,410,178
C2.....			1,208,340
C2 EUR.....			507
CX.....			16,586
I.....			3,693,706
I EUR.....			3,381
I2.....			7,357,542
I2 EUR.....			4,823
I2 EUR H.....			1,783,054
IT EUR H.....			1,712
IX.....			89,891
N2.....			390,992
NT.....			364,369
S.....			1,226
S1.....			9,242,603
S1 AUD H.....			20,162
S1 EUR.....			541
S1 EUR H.....			90
S1 JPY.....			244
SA.....			324,507

	Dynamic Diversified Portfolio		
	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
Nettovermögen.....	\$ 34,035,573	\$ 35,394,677	\$ 45,321,350
Klasse			
A	\$ 20.27	\$ 20.28	\$ 24.23
A EUR	€ 19.16	€ 20.18	€ 20.52
A EUR H	€ 17.08	€ 17.41	€ 21.21
AX	\$ 24.45	\$ 24.45	\$ 29.21
AX EUR	€ 23.11	€ 24.33	€ 24.73
AX SGD	SGD 32.99	SGD 34.20	SGD 39.30
BX	\$ 20.38	\$ 20.49	\$ 24.71
BX SGD (1)	N/A	SGD 28.69	SGD 33.27
C	\$ 19.66	\$ 19.70	\$ 23.61
C EUR	€ 18.59	€ 19.60	€ 20.00
C EUR H	€ 16.54	€ 16.89	€ 20.68
CX	\$ 23.26	\$ 23.30	\$ 27.91
I	\$ 21.85	\$ 21.79	\$ 25.86
I EUR	€ 20.66	€ 21.68	€ 21.90
I EUR H	€ 18.42	€ 18.71	€ 22.63
IX	\$ 27.55	\$ 27.46	\$ 32.57
S1 EUR H	N/A	N/A	€ 23.91

	Global Equity Blend Portfolio		
	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
Nettovermögen.....	\$ 93,141,249	\$ 92,151,147	\$ 136,340,283
Klasse			
A	\$ 24.05	\$ 23.07	\$ 29.48
A EUR	€ 22.74	€ 22.96	€ 24.97
A EUR H	€ 20.62	€ 20.21	€ 26.48
A SGD	SGD 32.46	SGD 32.27	SGD 39.67
B	\$ 19.80	\$ 19.08	\$ 24.63
B SGD	SGD 26.72	SGD 26.69	SGD 33.14
C	\$ 22.27	\$ 21.41	\$ 27.48
C EUR	€ 13.39	€ 13.54	€ 23.28
I	\$ 28.20	\$ 26.94	\$ 34.15
I EUR	€ 26.66	€ 26.80	€ 28.92
S HKD	HKD 273.00	HKD 259.26	HKD 321.85
S1	\$ 30.84	\$ 29.40	\$ 37.09
S1 EUR	€ 29.16	€ 29.25	€ 31.41
S1 GBP	£ 25.65	£ 25.31	£ 26.98
S1 SGD	SGD 41.63	SGD 41.12	SGD 49.91

	Global Value Portfolio		
	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
Nettovermögen.....	\$ 645,538,221	\$ 663,787,570	\$ 931,336,021
Klasse			
A	\$ 19.35	\$ 18.03	\$ 22.10
A EUR	€ 18.29	€ 17.93	€ 18.72
A SGD	SGD 26.12	SGD 25.21	SGD 29.74
A SGD H	SGD 19.30	SGD 18.12	SGD 22.33
AD	\$ 13.90	\$ 13.22	\$ 16.83
AD AUD H	AUD 12.45	AUD 12.02	AUD 15.52
AD CAD H	CAD 12.94	CAD 12.40	CAD 15.90
AD EUR H	€ 13.44	€ 12.90	€ 16.58
AD GBP H	£ 12.88	£ 12.38	£ 15.93
AD HKD	HKD 109.15	HKD 103.82	HKD 130.89
AD SGD H	N/A	N/A	SGD 16.49
AD ZAR H	R 85.58	R 82.05	R 105.47
B	\$ 15.59	\$ 14.59	\$ 18.07
BD	N/A	N/A	\$ 17.13
C	\$ 17.72	\$ 16.55	\$ 20.38
C EUR	€ 16.76	€ 16.46	€ 17.26
I	\$ 22.88	\$ 21.23	\$ 25.82
I EUR	€ 21.63	€ 21.13	€ 21.86
I GBP	£ 15.23	£ 14.63	N/A
I SGD	SGD 30.87	SGD 29.69	SGD 34.74
S	\$ 27.12	\$ 25.06	\$ 30.21
S GBP	£ 22.56	£ 21.59	£ 21.99
S GBP H	£ 20.73	£ 19.42	£ 23.67
S1	\$ 24.12	\$ 22.37	\$ 27.16
S1 AUD H (2)	AUD 115.58	N/A	N/A
S1 EUR	€ 22.82	€ 22.26	€ 23.00
S1 GBP	£ 20.07	£ 19.26	£ 19.76
SD	\$ 94.22	\$ 89.62	\$ 113.75
	Emerging Markets Growth Portfolio		
	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
Nettovermögen.....	\$ 623,708,005	\$ 546,098,583	\$ 741,958,125
Klasse			
A	\$ 41.67	\$ 42.46	\$ 55.85
A AUD H	AUD 17.63	AUD 18.31	AUD 24.54
A EUR	€ 39.38	€ 42.24	€ 47.29
A HKD	HKD 327.11	HKD 333.27	HKD 434.41
A PLN H	PLN 94.50	PLN 94.78	PLN 124.64
A SGD	SGD 56.24	SGD 59.38	SGD 75.15
A SGD H	SGD 14.04	SGD 14.42	SGD 19.07
AD	\$ 15.19	\$ 15.78	\$ 21.42
B	\$ 30.97	\$ 31.72	\$ 42.14
C	\$ 34.05	\$ 34.77	\$ 45.94
CAUD H	N/A	N/A	AUD 23.10
C EUR	€ 32.19	€ 34.59	€ 38.91
ED	\$ 10.92	\$ 11.34	\$ 15.41
I	\$ 51.30	\$ 52.07	\$ 67.94

Emerging Markets Growth Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
I AUD H	AUD 19.33	AUD 19.98	AUD 26.53
I EUR	€ 48.50	€ 51.80	€ 57.54
N	\$ 20.39	\$ 20.81	\$ 27.50
S	N/A	N/A	\$ 81.32
S1	\$ 53.51	\$ 54.26	\$ 70.69
S1 EUR	€ 50.65	€ 54.03	€ 59.87
S1 GBP	£ 44.56	£ 46.77	£ 51.44

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
Nettovermögen.....	\$ 366,582,147	\$ 495,340,478	\$ 373,849,113
Klasse			
A	\$ 21.69	\$ 21.89	\$ 27.61
A AUD H	AUD 21.03	AUD 21.66	AUD 27.70
A EUR	€ 20.50	€ 21.77	€ 23.38
A HKD	HKD 170.25	HKD 171.82	HKD 214.74
A SGD H	SGD 15.40	SGD 15.69	SGD 19.86
AD	\$ 13.33	\$ 13.74	\$ 17.93
AD AUD H	AUD 11.22	AUD 11.75	AUD 15.54
AD CAD H	CAD 9.66	CAD 10.04	CAD 13.21
AD EUR	€ 12.68	€ 13.71	€ 15.18
AD EUR H	€ 11.98	€ 12.46	€ 16.40
AD GBP H	£ 11.89	£ 12.39	£ 16.34
AD HKD	HKD 104.71	HKD 107.91	HKD 139.44
AD NZD H	NZD 12.25	NZD 12.84	NZD 16.92
AD RMB H	CNH 81.77	CNH 85.40	CNH 111.59
AD SGD H	N/A	N/A	SGD 17.08
AD ZAR H	R 86.93	R 90.69	R 119.83
AY JPY	¥ 2.13	¥ 2.19	¥ 2.19
BD (3)	N/A	\$ 13.65	\$ 17.83
BD AUD H (4)	N/A	AUD 11.74	AUD 15.56
BD CAD H	N/A	N/A	CAD 13.80
BD HKD (5)	N/A	HKD 107.18	HKD 138.72
BD NZD H	N/A	N/A	NZD 16.82
BD ZAR H	N/A	N/A	R 107.61
BY JPY	¥ 2.02	¥ 2.08	¥ 2.09
C	\$ 20.43	\$ 20.67	\$ 26.19
C AUD H	N/A	N/A	AUD 26.85
C EUR	€ 19.31	€ 20.57	€ 22.17
ED	\$ 11.46	\$ 11.79	\$ 15.36
ED AUD H	AUD 13.38	AUD 13.98	N/A
I	\$ 24.13	\$ 24.25	\$ 30.34
I AUD H	AUD 23.73	AUD 24.34	AUD 30.88
I EUR	€ 22.80	€ 24.13	€ 25.70
I GBP	£ 22.52	£ 23.45	£ 24.79
ID	N/A	N/A	\$ 17.97
ID AUD H	N/A	N/A	AUD 15.83
S	\$ 27.84	\$ 27.85	\$ 34.48
S HKD	HKD 218.59	HKD 218.61	HKD 268.21

Asia Ex-Japan Equity Portfolio (Fortsetzung)			
	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
S1	\$ 24.66	\$ 24.78	\$ 30.96
S1 EUR	€ 23.33	€ 24.66	€ 26.22
SD	\$ 91.41	\$ 94.48	\$ 123.26
Japan Strategic Value Portfolio			
	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
Nettovermögen.....	¥ 6,278,845,928	¥ 6,696,083,364	¥ 8,483,000,365
Klasse			
A	¥ 12,257.00	¥ 12,031.00	¥ 11,676.00
A AUD H	N/A	N/A	AUD 22.71
A CZK H	CZK 1,062.58	CZK 1,009.83	CZK 952.60
A EUR	€ 85.18	€ 86.22	€ 89.97
A EUR H	€ 28.26	€ 27.64	€ 27.12
A NZD H	N/A	N/A	NZD 24.85
A PLN	PLN 400.60	PLN 407.17	PLN 406.65
A SGD	SGD 121.44	SGD 121.07	SGD 142.75
A SGD H	SGD 17.91	SGD 17.29	SGD 16.72
A USD	\$ 90.06	\$ 86.63	\$ 106.17
A USD H	\$ 35.63	\$ 34.28	\$ 33.08
AD	¥ 11,945.00	¥ 11,876.00	¥ 11,823.00
AD AUD H	AUD 15.52	AUD 15.49	AUD 15.58
AD NZD H	NZD 16.03	NZD 15.97	NZD 16.06
AD USD H	\$ 15.62	\$ 15.52	\$ 15.48
AD ZAR H	R 109.52	R 109.05	R 108.96
BD AUD H	N/A	N/A	AUD 15.40
C	¥ 11,286.00	¥ 11,128.00	¥ 10,880.00
C EUR	€ 78.48	€ 79.82	€ 83.88
C EUR H	€ 26.27	€ 25.81	€ 25.51
C USD	\$ 82.96	\$ 80.16	\$ 98.97
I	¥ 13,972.00	¥ 13,666.00	¥ 13,154.00
I EUR	€ 97.20	€ 98.03	€ 101.40
I EUR H	€ 31.26	€ 30.46	€ 29.65
I SGD	SGD 138.51	SGD 137.54	SGD 160.88
I USD	\$ 102.71	\$ 98.42	\$ 119.65
I USD H	\$ 38.98	\$ 37.36	\$ 35.77
S EUR H	€ 31.37	€ 30.46	€ 29.38
S1 EUR	€ 103.34	€ 104.16	€ 107.51
S1 USD	\$ 109.23	\$ 104.61	\$ 126.86
S1 USD H	N/A	N/A	\$ 25.78
SD	¥ 13,036.00	¥ 12,939.00	¥ 12,815.00

	China Low Volatility Equity Portfolio		
	28. Februar 2023	31. August 2022	31. August 2021
	(ungeprüft)^		
Nettovermögen.....	<u>\$ 123,797,509</u>	<u>\$ 121,824,745</u>	<u>\$ 153,597,072</u>
Klasse			
A	\$ 45.95	\$ 47.68	\$ 64.41
A EUR	€ 43.44	€ 47.44	€ 54.54
A HKD	HKD 360.73	HKD 374.26	HKD 501.00
A PLN H	PLN 78.62	PLN 80.57	PLN 107.36
AD	\$ 12.69	\$ 13.51	\$ 19.09
AD AUD H	AUD 11.12	AUD 12.03	AUD 17.23
AD CAD H	CAD 11.65	CAD 12.47	CAD 17.80
AD EUR H	€ 11.99	€ 12.87	€ 18.37
AD GBP H	£ 11.77	£ 12.65	£ 18.08
AD HKD	HKD 99.65	HKD 106.05	HKD 148.48
AD NZD H	NZD 11.43	NZD 12.39	NZD 17.67
AD RMB H	N/A	N/A	CNH 122.63
AD SGD H	SGD 11.90	SGD 12.77	SGD 18.12
AD ZAR H	R 74.60	R 80.64	R 116.49
B	\$ 35.66	\$ 37.19	\$ 50.74
B EUR	€ 33.71	€ 37.00	€ 42.97
BD NZD H (6)	N/A	NZD 12.46	NZD 17.76
BD ZAR H	N/A	N/A	R 117.43
C	\$ 42.76	\$ 44.46	\$ 60.34
C EUR	€ 40.42	€ 44.24	€ 51.10
I	\$ 56.07	\$ 57.96	\$ 77.67
I EUR	€ 53.02	€ 57.67	€ 65.78
S	\$ 71.43	\$ 73.44	\$ 97.41
S1	\$ 63.03	\$ 65.05	\$ 86.93
S1 EUR	€ 59.60	€ 64.74	€ 73.63

	Short Duration Bond Portfolio		
	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
Nettovermögen	\$ 484,156,554	\$ 479,574,798	\$ 531,284,341
Klasse			
A	\$ 7.04	\$ 7.13	\$ 7.59
A EUR	€ 6.66	€ 7.11	€ 6.43
A2	\$ 17.74	\$ 17.74	\$ 18.45
A2 EUR	€ 16.78	€ 17.66	€ 15.63
A2 EUR H	€ 13.54	€ 13.73	€ 14.48
A2 HKD	HKD 139.34	HKD 139.28	HKD 143.56
A2 SGD H	N/A	N/A	SGD 15.59
AA	\$ 10.49	\$ 10.70	\$ 11.52
AA AUD H	AUD 10.28	AUD 10.51	AUD 11.34
AA CAD H	CAD 10.53	CAD 10.75	CAD 11.58
AA GBPH	£ 10.46	£ 10.69	£ 11.53
AA HKD	HKD 82.38	HKD 84.03	HKD 89.65
AA NZD H	N/A	N/A	NZD 11.67
AA SGD H	SGD 10.49	SGD 10.71	SGD 11.53
AJ	\$ 6.77	\$ 6.86	\$ 7.30
AR EUR H	N/A	N/A	€ 11.95
AT	\$ 7.03	\$ 7.12	\$ 7.58
AT AUD H	AUD 10.89	AUD 11.07	AUD 11.81
AT CAD H	CAD 11.10	CAD 11.26	CAD 11.98
AT EUR	€ 6.66	€ 7.11	€ 6.42
AT EUR H	€ 10.73	€ 10.89	€ 11.60
AT GBPH	£ 11.15	£ 11.32	£ 12.07
AT HKD	HKD 55.22	HKD 55.98	HKD 58.97
AT NZD H	NZD 11.27	NZD 11.44	NZD 12.18
AT SGD H	SGD 11.45	SGD 11.62	SGD 12.36
AX	\$ 5.62	\$ 5.70	\$ 6.06
B	\$ 7.04	\$ 7.14	\$ 7.59
B2 EUR	N/A	N/A	€ 12.18
BT	N/A	N/A	\$ 7.63
C	\$ 7.04	\$ 7.14	\$ 7.59
C2	\$ 14.54	\$ 14.56	\$ 15.21
C2 EUR H	€ 12.79	€ 12.98	€ 13.74
I	\$ 7.04	\$ 7.14	\$ 7.59
I EUR	€ 6.66	€ 7.12	€ 6.43
I2	\$ 12.94	\$ 12.90	\$ 13.33
I2 AUD H	N/A	N/A	AUD 20.07
I2 EUR	€ 12.23	€ 12.83	€ 11.29
I2 EUR H	€ 14.54	€ 14.70	€ 15.41
IT	\$ 11.56	\$ 11.72	\$ 12.46
IT AUD H	N/A	N/A	AUD 12.35
N2	\$ 14.06	\$ 14.09	\$ 14.73
NT	\$ 11.40	\$ 11.56	\$ 12.29
S	\$ 91.39	\$ 92.67	\$ 98.58
S EUR H	N/A	N/A	€ 16.52
S SGD H	N/A	N/A	SGD 17.99
S1 2	\$ 16.44	\$ 16.36	\$ 16.88
S1 2 EUR	€ 15.54	€ 16.28	€ 14.29
S1 EUR H	N/A	N/A	€ 15.66
SA	\$ 79.21	\$ 80.36	\$ 85.58

	Global High Yield Portfolio		
	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
Nettovermögen	\$ 13,996,885,172	\$ 14,421,357,362	\$ 20,805,945,914
Klasse			
A	\$ 3.07	\$ 3.09	\$ 3.82
A EUR	€ 2.92	€ 3.08	€ 3.23
A2	\$ 15.60	\$ 15.12	\$ 17.48
A2 CHF H	CHF 14.25	CHF 14.11	CHF 16.63
A2 EUR	€ 14.75	€ 15.04	€ 14.80
A2 EUR H	€ 21.62	€ 21.32	€ 25.09
A2 HKD	HKD 122.48	HKD 118.67	HKD 135.99
A2 PLN H	PLN 100.35	PLN 95.78	PLN 108.67
A2 SGD	SGD 21.05	SGD 21.14	SGD 23.52
A2 SGD H	SGD 20.13	SGD 19.62	SGD 22.75
AA	\$ 8.12	\$ 8.28	\$ 10.47
AA AUD H	AUD 7.56	AUD 7.76	AUD 9.91
AA CAD H	CAD 7.69	CAD 7.87	CAD 9.99
AA EUR H	€ 7.81	€ 8.00	€ 10.17
AA GBP H	£ 7.62	£ 7.83	£ 9.99
AA HKD	HKD 63.79	HKD 65.01	HKD 81.46
AA NZD H	NZD 7.65	NZD 7.85	NZD 10.01
AA RMB H	CNH 52.97	CNH 54.32	CNH 68.85
AA SGD H	SGD 7.90	SGD 8.09	SGD 10.26
AA ZAR H	R 52.15	R 53.40	R 67.97
AK	\$ 9.94	\$ 10.01	\$ 12.43
AK EUR	€ 9.47	€ 10.01	€ 10.54
AK EUR H	€ 9.72	€ 9.84	€ 12.24
AR EUR H	€ 8.61	€ 8.50	€ 10.73
AT	\$ 3.04	\$ 3.05	\$ 3.78
AT AUD H	AUD 10.06	AUD 10.20	AUD 12.74
AT CAD H	CAD 9.26	CAD 9.35	CAD 11.63
AT EUR	€ 2.89	€ 3.05	€ 3.20
AT EUR H	€ 10.29	€ 10.41	€ 12.95
AT GBP H	£ 10.17	£ 10.31	£ 12.87
AT HKD	HKD 23.85	HKD 23.99	HKD 29.42
AT NZD H	NZD 9.30	NZD 9.42	NZD 11.75
AT RMB H	CNH 67.16	CNH 67.98	CNH 84.34
AT SGD	SGD 4.10	SGD 4.28	SGD 5.09
AT SGD H	SGD 9.42	SGD 9.52	SGD 11.82
B	\$ 3.07	\$ 3.09	\$ 3.82
B2	\$ 22.00	\$ 21.42	\$ 25.02
BA	N/A	\$ 7.54	\$ 9.64
BAAUD H (7)	N/A	AUD 7.05	AUD 9.11
BA ZAR H	N/A	N/A	R 62.10
BT	\$ 3.10	\$ 3.12	\$ 3.86
BT AUD H	AUD 10.10	AUD 10.22	AUD 12.75
BT CAD H	N/A	N/A	CAD 11.64
BT EUR H	N/A	N/A	€ 12.98
BT GBP H	N/A	N/A	£ 12.89
BT HKD (8)	N/A	HKD 24.48	HKD 30.00
BT NZD H (9)	N/A	NZD 9.56	NZD 11.88
C	\$ 3.07	\$ 3.09	\$ 3.82
C EUR	€ 2.92	€ 3.08	€ 3.23

Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
C2	\$ 21.78	\$ 21.15	\$ 24.59
C2 EUR	€ 20.59	€ 21.05	€ 20.82
C2 EUR H	€ 16.94	€ 16.75	€ 19.81
CK	\$ 9.92	\$ 9.99	\$ 12.40
CK EUR H	€ 9.73	€ 9.85	€ 12.24
CT	\$ 10.33	\$ 10.39	\$ 12.86
EA	\$ 9.73	\$ 9.95	\$ 12.66
EA AUD H	AUD 9.97	AUD 10.26	AUD 13.18
EA ZAR H	R 67.73	R 69.54	R 89.01
I	\$ 3.06	\$ 3.09	\$ 3.82
I EUR	€ 2.92	€ 3.08	€ 3.23
I2	\$ 10.05	\$ 9.71	\$ 11.17
I2 AUD H	AUD 26.47	AUD 25.89	AUD 30.10
I2 CHF H	CHF 14.84	CHF 14.66	CHF 17.20
I2 EUR	€ 9.50	€ 9.66	€ 9.46
I2 EUR H	€ 23.09	€ 22.72	€ 26.61
I2 SGD	SGD 13.56	SGD 13.58	SGD 15.03
I2 SGD H	SGD 17.55	SGD 17.06	SGD 19.69
IA AUD H	AUD 9.66	AUD 9.90	AUD 12.60
IQD	\$ 9.75	\$ 9.80	\$ 12.16
IQD EUR (10)	N/A	€ 9.82	€ 10.30
IT	\$ 9.52	\$ 9.59	\$ 11.88
IT AUD H	AUD 8.92	AUD 9.05	AUD 11.32
IT CAD H	CAD 11.02	CAD 11.14	CAD 13.85
IT EUR H	€ 10.20	€ 10.32	€ 12.85
IT GBP H	£ 10.91	£ 11.07	£ 13.81
IT HKD	HKD 74.80	HKD 75.28	HKD 92.38
IT NZD H	N/A	N/A	NZD 13.73
IT RMB H	CNH 64.04	CNH 64.89	CNH 80.53
J	\$ 3.31	\$ 3.32	\$ 4.11
N2	\$ 17.93	\$ 17.42	\$ 20.26
NT	\$ 9.78	\$ 9.84	\$ 12.17
S1	\$ 27.08	\$ 26.14	\$ 30.03
S1 EUR	€ 25.60	€ 26.02	€ 25.43
S1D	\$ 15.06	\$ 14.96	\$ 17.98
S1D2 (11)	\$ 103.44	N/A	N/A
SA	\$ 63.77	\$ 64.44	\$ 80.17
SHK	\$ 70.56	\$ 71.27	\$ 88.60
SK	\$ 36.51	\$ 35.21	\$ 40.34
W	\$ 11.55	\$ 11.63	\$ 14.39
W EUR	€ 11.00	€ 11.61	€ 12.19
W2	\$ 15.56	\$ 15.03	\$ 17.27
W2 CHF H	CHF 13.55	CHF 13.38	CHF 15.66
W2 EUR H	€ 13.92	€ 13.68	€ 16.02
WT	\$ 10.50	\$ 10.57	\$ 13.10
WT AUD H	AUD 9.93	AUD 10.06	AUD 12.59
WT CAD H	CAD 11.19	CAD 11.31	CAD 14.06
WT EUR H	€ 10.24	€ 10.36	€ 12.90
WT GBP H	£ 11.05	£ 11.21	£ 13.99
WT RMB H	CNH 75.62	CNH 76.63	CNH 95.08

	American Income Portfolio		
	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
Nettovermögen.....	\$ 18,487,462,356	\$ 16,566,716,085	\$ 24,837,439,539
Klasse			
A	\$ 6.47	\$ 6.69	\$ 8.12
A EUR	€ 6.17	€ 6.68	€ 6.88
A2	\$ 28.44	\$ 28.52	\$ 32.84
A2 CHF H	CHF 14.26	CHF 14.64	CHF 17.19
A2 DUR PH	\$ 18.94	\$ 17.99	\$ 18.86
A2 EUR	€ 26.89	€ 28.37	€ 27.81
A2 EUR H	€ 17.11	€ 17.47	€ 20.47
A2 HKD	HKD 223.28	HKD 223.83	HKD 255.44
A2 PLN H	PLN 98.81	PLN 97.57	PLN 109.95
A2 SGD	SGD 38.39	SGD 39.88	SGD 44.19
A2 SGD H	SGD 19.18	SGD 19.33	SGD 22.30
AA	\$ 9.73	\$ 10.14	\$ 12.51
AA AUD H	AUD 9.27	AUD 9.73	AUD 12.08
AA CAD H	CAD 9.26	CAD 9.68	CAD 11.97
AA DUR PH	\$ 10.50	\$ 10.34	\$ 11.59
AA EUR H	€ 9.27	€ 9.70	€ 12.02
AA GBP H	£ 9.13	£ 9.58	£ 11.89
AA HKD	HKD 76.41	HKD 79.60	HKD 97.28
AA NZD H	NZD 9.22	NZD 9.67	NZD 11.99
AA RMB H	CNH 63.05	CNH 66.07	CNH 81.62
AA SGD H	SGD 9.46	SGD 9.89	SGD 12.23
AA ZAR H	R 63.96	R 66.91	R 82.71
AK	\$ 10.73	\$ 11.10	\$ 13.53
AK EUR	€ 10.27	€ 11.13	€ 11.46
AK EUR H	€ 10.53	€ 10.96	€ 13.36
AR EUR	€ 10.79	€ 11.38	€ 12.00
AR EUR H	€ 9.74	€ 9.95	€ 12.21
AT	\$ 6.46	\$ 6.68	\$ 8.12
AT AUD H	AUD 10.60	AUD 11.04	AUD 13.51
AT CAD H	CAD 10.62	CAD 11.01	CAD 13.43
AT DUR PH	\$ 12.04	\$ 11.74	\$ 12.95
AT EUR	€ 6.16	€ 6.68	€ 6.87
AT EUR H	€ 10.60	€ 11.02	€ 13.45
AT GBP H	£ 10.48	£ 10.91	£ 13.33
AT HKD	HKD 50.75	HKD 52.44	HKD 63.13
AT NZD H	NZD 10.11	NZD 10.52	NZD 12.85
AT RMB H	CNH 71.91	CNH 74.80	CNH 91.05
AT SGD	SGD 8.73	SGD 9.35	SGD 10.92
AT SGD H	SGD 10.71	SGD 11.10	SGD 13.52
B	\$ 6.48	\$ 6.69	\$ 8.12
B2	\$ 22.36	\$ 22.50	\$ 26.09
B2 HKD (12)	N/A	HKD 176.60	HKD 202.95
BA (13)	N/A	\$ 9.51	\$ 11.82
BA AUD H (14)	N/A	AUD 9.10	AUD 11.38
BA ZAR H	N/A	N/A	R 78.64
BT	\$ 6.52	\$ 6.74	\$ 8.18
BT AUD H (15)	N/A	AUD 11.12	AUD 13.59
BT CAD H (16)	N/A	CAD 10.94	CAD 13.31
BT EUR	N/A	N/A	€ 6.93

American Income Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
BT EUR H	N/A	€ 11.03	€ 13.45
BT GBP H (17)	N/A	£ 11.00	£ 13.43
BT HKD (18)	N/A	HKD 52.91	HKD 63.64
BT NZD H (19)	N/A	NZD 10.59	NZD 12.92
C	\$ 6.48	\$ 6.69	\$ 8.12
C EUR	€ 6.18	€ 6.69	€ 6.88
C2	\$ 34.35	\$ 34.52	\$ 39.93
C2 DUR PH	\$ 18.11	\$ 17.25	\$ 18.16
C2 EUR	€ 32.48	€ 34.34	€ 33.82
C2 EUR H	€ 16.21	€ 16.58	€ 19.51
CT	\$ 10.84	\$ 11.19	\$ 13.59
EA	\$ 11.10	\$ 11.59	\$ 14.38
EA AUD H	AUD 10.68	AUD 11.23	AUD 14.02
EA ZAR H	R 73.27	R 76.85	R 95.55
I	\$ 6.46	\$ 6.69	\$ 8.12
I EUR	€ 6.17	€ 6.68	€ 6.88
I2	\$ 17.12	\$ 17.12	\$ 19.61
I2 AUD H	AUD 14.81	AUD 14.97	AUD 17.29
I2 CHF H	CHF 15.09	CHF 15.44	CHF 18.03
I2 DUR PH	\$ 19.74	\$ 18.70	\$ 19.49
I2 EUR	€ 16.19	€ 17.03	€ 16.60
I2 EUR H	€ 18.69	€ 19.03	€ 22.17
I2 HKD	HKD 134.40	HKD 134.36	HKD 152.50
I2 SGD	SGD 23.12	SGD 23.95	SGD 26.38
I2 SGD H	SGD 17.30	SGD 17.39	SGD 19.96
IA	\$ 11.22	\$ 11.66	\$ 14.30
IA AUD H	AUD 10.75	AUD 11.25	AUD 13.89
IT	\$ 10.53	\$ 10.90	\$ 13.25
IT AUD H	AUD 9.91	AUD 10.32	AUD 12.64
IT CAD H	CAD 11.57	CAD 12.01	CAD 14.64
IT EUR H	€ 11.53	€ 12.00	€ 14.65
IT GBP H	£ 11.42	£ 11.91	£ 14.57
IT HKD	HKD 82.74	HKD 85.57	HKD 103.07
IT JPY	¥ 9,959.00	¥ 10,425.00	¥ 9,954.00
IT JPY H	¥ 6,730.00	¥ 7,002.00	¥ 8,565.00
IT NZD H	NZD 11.46	NZD 11.94	NZD 14.60
IT RMB H	CNH 78.19	CNH 81.38	CNH 99.14
IT SGD	SGD 14.24	SGD 15.26	SGD 17.83
IT SGD H	SGD 10.82	SGD 11.23	SGD 13.68
J	\$ 6.61	\$ 6.82	\$ 8.28
L2	\$ 14.10	\$ 14.12	\$ 16.22
L2 AUD H	N/A	N/A	AUD 15.78
L2 SGD H	N/A	N/A	SGD 16.06
LT	\$ 11.66	\$ 12.06	\$ 14.66
LT AUD H	N/A	N/A	AUD 14.43
LT SGD H	N/A	N/A	SGD 14.69
N2	\$ 16.64	\$ 16.73	\$ 19.38
NT	\$ 10.53	\$ 10.88	\$ 13.21
S	\$ 19.99	\$ 19.92	\$ 22.65

American Income Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
S1	\$ 22.19	\$ 22.16	\$ 25.33
S1 EUR (20)	N/A	€ 22.05	€ 21.45
S1D	\$ 13.31	\$ 13.66	\$ 16.32
S1D2	\$ 76.41	\$ 79.07	\$ 96.17
SA	\$ 72.85	\$ 75.39	\$ 91.74
SHK	\$ 75.76	\$ 78.38	\$ 95.32
W	\$ 11.63	\$ 12.03	\$ 14.62
W2	\$ 15.82	\$ 15.80	\$ 18.07
W2 CHF H	CHF 13.75	CHF 14.06	CHF 16.39
W2 EUR H	€ 14.04	€ 14.29	€ 16.61
WT	\$ 11.63	\$ 12.04	\$ 14.64
WT AUD H	AUD 11.15	AUD 11.62	AUD 14.23
WT EUR H	€ 11.59	€ 12.06	€ 14.73
WT GBPH	£ 11.41	£ 11.88	£ 14.54
WT HKD	HKD 91.38	HKD 94.52	HKD 113.86
WT SGD H	SGD 11.49	SGD 11.92	SGD 14.53

European Income Portfolio

	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
Nettovermögen	€ 1,241,760,728	€ 1,411,076,501	€ 2,245,496,354
Klasse			
A	€ 5.64	€ 5.76	€ 6.87
A USD	\$ 5.93	\$ 5.77	\$ 8.11
A2	€ 19.20	€ 19.23	€ 22.14
A2 CHF H	CHF 14.62	CHF 14.70	CHF 16.97
A2 PLN H	PLN 103.30	PLN 100.08	PLN 110.81
A2 SGD H	N/A	N/A	SGD 19.17
A2 USD	\$ 20.31	\$ 19.33	\$ 26.14
A2 USD H	\$ 17.80	\$ 17.53	\$ 19.86
AA	€ 10.15	€ 10.44	€ 12.63
AA AUD H	AUD 9.90	AUD 10.21	AUD 12.39
AA HKD H	HKD 67.65	HKD 69.43	HKD 83.93
AA RMB H	CNH 67.66	CNH 69.66	CNH 84.11
AA SGD H	SGD 10.09	SGD 10.37	SGD 12.52
AA USD H	\$ 10.32	\$ 10.57	\$ 12.75
AK	€ 11.86	€ 12.12	€ 14.49
AR	€ 10.28	€ 10.29	€ 12.48
AT	€ 5.64	€ 5.76	€ 6.88
AT AUD H	AUD 12.00	AUD 12.29	AUD 14.70
AT SGD H	SGD 11.51	SGD 11.75	SGD 13.98
AT USD	\$ 5.93	\$ 5.77	\$ 8.12
AT USD H	\$ 12.45	\$ 12.67	\$ 15.06
B USD	\$ 5.95	\$ 5.78	\$ 8.11
B2	€ 16.29	€ 16.37	€ 18.98
B2 USD	\$ 17.23	\$ 16.45	\$ 22.41
BA	N/A	N/A	€ 11.95
BA AUD H (21)	N/A	AUD 9.59	AUD 11.72
BA USD H (22)	N/A	\$ 9.94	\$ 12.06
BT (23)	N/A	€ 5.77	€ 6.88

European Income Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
BT AUD H (24)	N/A	AUD 12.34	AUD 14.74
BT USD	N/A	N/A	\$ 8.12
BT USD H (25)	N/A	\$ 12.67	\$ 15.06
C	€ 5.65	€ 5.77	€ 6.87
C USD	\$ 5.94	\$ 5.78	\$ 8.11
C2	€ 18.04	€ 18.11	€ 20.94
C2 USD	\$ 19.08	\$ 18.20	\$ 24.73
C2 USD H	\$ 16.87	\$ 16.65	\$ 18.95
CK	€ 11.87	€ 12.12	€ 14.47
CT USD H	\$ 11.48	\$ 11.67	\$ 13.88
I	€ 5.64	€ 5.76	€ 6.87
I USD	\$ 5.91	\$ 5.77	\$ 8.11
I2	€ 12.98	€ 12.96	€ 14.84
I2 AUD H	AUD 28.26	AUD 28.05	AUD 31.88
I2 CHF H	CHF 15.02	CHF 15.06	CHF 17.29
I2 USD	\$ 13.73	\$ 13.03	\$ 17.52
I2 USD H	\$ 25.55	\$ 25.09	\$ 28.28
IA	€ 11.23	€ 11.52	€ 13.86
IA HKD H	HKD 75.49	HKD 77.21	HKD 92.75
IA SGD H	SGD 11.24	SGD 11.52	SGD 13.82
IA USD H	\$ 11.47	\$ 11.72	\$ 14.05
IT	€ 11.93	€ 12.19	€ 14.54
IT SGD H	SGD 11.96	SGD 12.21	SGD 14.53
IT USD H	\$ 11.81	\$ 12.02	\$ 14.29
NT USD H	\$ 12.06	\$ 12.27	\$ 14.59
S1	€ 21.32	€ 21.27	€ 24.30
S1 USD	\$ 22.55	\$ 21.38	\$ 28.69
S1 USD H	\$ 24.02	\$ 23.56	\$ 26.49
S1D	€ 11.78	€ 12.05	€ 14.39
SA USD H	\$ 78.10	\$ 79.48	\$ 94.84
SHK	€ 77.80	€ 79.48	€ 94.85
W2	€ 14.01	€ 13.98	€ 15.98
W2 CHF H	CHF 14.48	CHF 14.51	CHF 16.63
W2 USD H	\$ 14.91	\$ 14.63	\$ 16.46
WA	€ 11.88	€ 12.18	€ 14.63
WA HKD H	HKD 79.79	HKD 81.55	HKD 97.78
WA USD H	\$ 12.05	\$ 12.29	\$ 14.71
WT	€ 12.15	€ 12.42	€ 14.82
WT SGD H	SGD 12.21	SGD 12.47	SGD 14.84
WT USD H	\$ 12.31	\$ 12.53	\$ 14.91

	Emerging Markets Debt Portfolio		
	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
Nettovermögen	\$ 489,502,638	\$ 502,511,882	\$ 870,118,646
Klasse			
A	\$ 10.38	\$ 10.53	\$ 14.52
A EUR	€ 9.90	€ 10.53	€ 12.30
A2	\$ 28.26	\$ 27.73	\$ 36.18
A2 CHF H	CHF 12.34	CHF 12.38	CHF 16.46
A2 EUR	€ 26.71	€ 27.59	€ 30.64
A2 EUR H	€ 16.78	€ 16.78	€ 22.31
A2 HKD	HKD221.81	HKD217.64	HKD 281.39
A2 PLN	PLN 125.71	PLN 130.32	PLN 138.56
A2 PLN H	PLN 88.65	PLN 85.54	PLN 110.09
A2 SGD H	SGD 17.53	SGD 17.30	SGD 22.64
AA	\$ 8.51	\$ 8.70	\$ 12.19
AA AUD H	AUD 7.89	AUD 8.14	AUD 11.50
AA CAD H	CAD 7.81	CAD 8.01	CAD 11.27
AA EUR H	€ 7.90	€ 8.12	€ 11.45
AA GBP H	£ 7.73	£ 7.97	£ 11.25
AA HKD	HKD 66.83	HKD 68.29	HKD 94.81
AA NZD H	NZD 7.68	NZD 7.93	NZD 11.20
AA RMB H	CNH 59.25	CNH 61.00	CNH 85.67
AA SGD H	SGD 8.24	SGD 8.45	SGD 11.88
AA ZAR H	R 54.34	R 55.89	R 78.80
AI	\$ 49.75	\$ 51.66	\$ 74.73
AI AUD H	AUD 48.77	AUD 51.10	AUD 74.55
AR EUR	€ 9.61	€ 9.93	€ 11.88
AT	\$ 10.41	\$ 10.57	\$ 14.58
AT AUD H	AUD 9.03	AUD 9.25	AUD 12.88
AT CAD H	CAD 8.35	CAD 8.51	CAD 11.79
AT EUR	€ 9.94	€ 10.57	€ 12.35
AT EUR H	€ 9.43	€ 9.63	€ 13.38
AT GBP H	£ 8.32	£ 8.51	£ 11.83
AT HKD	HKD 81.79	HKD 82.98	HKD 113.43
AT NZD H	NZD 8.07	NZD 8.28	NZD 11.52
AT RMB H	N/A	N/A	CNH 88.59
AT SGD H	SGD 9.09	SGD 9.27	SGD 12.83
B2 EUR	N/A	N/A	€ 26.25
B2 HKD (26)	N/A	HKD184.66	HKD 241.14
BA	N/A	N/A	\$ 11.25
BA AUD H	N/A	N/A	AUD 10.63
BA ZAR H	N/A	N/A	R 72.43
BT	\$ 10.43	\$ 10.56	\$ 14.54
BT AUD H	N/A	N/A	AUD 12.90
BT EUR H	N/A	N/A	€ 13.41
BT HKD	N/A	N/A	HKD 113.12
C	\$ 10.40	\$ 10.54	\$ 14.53
C EUR	€ 9.92	€ 10.53	€ 12.30
C2	\$ 26.16	\$ 25.73	\$ 33.72
C2 EUR	€ 24.73	€ 25.60	€ 28.55
C2 EUR H	€ 15.90	€ 15.94	€ 21.29

Emerging Markets Debt Portfolio (Fortsetzung)

	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
CT	\$ 8.83	\$ 8.95	\$ 12.34
EA	\$ 9.94	\$ 10.19	\$ 14.35
EA AUD H	AUD 9.45	AUD 9.77	AUD 13.88
EA ZAR H	R 64.43	R 66.43	R 94.15
EI	\$ 49.22	\$ 51.24	\$ 74.50
EI AUD H	AUD 48.24	AUD 50.69	AUD 74.36
I	\$ 10.36	\$ 10.52	\$ 14.53
I2	\$ 30.99	\$ 30.33	\$ 39.36
I2 AUD H	AUD 14.06	AUD 13.94	N/A
I2 CHF H	CHF 13.06	CHF 13.06	CHF 17.27
I2 EUR	€ 29.30	€ 30.18	€ 33.33
I2 EUR H	€ 18.08	€ 18.03	€ 23.84
IT AUD H	AUD 8.11	AUD 8.30	AUD 11.57
IT EUR H	€ 9.01	€ 9.20	€ 12.79
IT SGD H	N/A	N/A	SGD 12.01
N2	\$ 14.47	\$ 14.24	\$ 18.68
NT	\$ 8.58	\$ 8.70	\$ 11.99
S	\$ 30.90	\$ 30.13	\$ 38.83
S EUR H	N/A	N/A	€ 24.53
S GBP H	N/A	N/A	£ 25.92
S1 2	\$ 28.82	\$ 28.18	\$ 36.52
S1 2 EUR	€ 27.27	€ 28.06	€ 30.93
S1 EUR H	€ 17.51	€ 17.45	€ 23.04
S1 GBP H	£ 18.86	£ 18.67	£ 24.36
S1QD EUR H	N/A	N/A	€ 98.69
SA	\$ 63.74	\$ 64.72	\$ 89.53

	Mortgage Income Portfolio		
	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
Nettovermögen.....	\$ 813,325,496	\$ 829,713,296	\$1,493,772,913
Klasse			
A	\$ 11.09	\$ 11.22	\$ 12.18
A2	\$ 18.28	\$ 17.83	\$ 18.33
A2 EUR	€ 17.28	€ 17.74	€ 15.52
A2 HKD	HKD 143.49	HKD 139.98	HKD 142.59
A2 SGD	SGD 24.67	SGD 24.94	SGD 24.67
A2X	\$ 13.10	\$ 12.78	\$ 13.13
A2X EUR	€ 12.39	€ 12.71	€ 11.12
AA	\$ 9.71	\$ 9.89	\$ 10.91
AA AUD H	AUD 9.33	AUD 9.53	AUD 10.55
AA HKD	HKD 76.27	HKD 77.67	HKD 84.83
AA RMB H	CNH 66.11	CNH 67.55	CNH 74.47
AA SGD H	SGD 9.59	SGD 9.78	SGD 10.79
AA ZAR H	R 64.97	R 66.17	R 72.79
AR EUR H	€ 9.79	€ 9.70	€ 10.87
AT	\$ 11.11	\$ 11.24	\$ 12.21
AT AUD H	AUD 10.72	AUD 10.87	AUD 11.86
AT EUR	€ 10.54	€ 11.23	€ 10.34
AT GBP H	£ 11.55	£ 11.72	£ 12.77
AT HKD	HKD 87.29	HKD 88.26	HKD 94.97
AT SGD	SGD 14.99	SGD 15.73	SGD 16.43
AT SGD H	SGD 10.96	SGD 11.09	SGD 12.07
AX	\$ 5.37	\$ 5.43	\$ 5.90
AX EUR	€ 5.10	€ 5.43	€ 5.00
B2X	N/A	N/A	\$ 12.41
BX	\$ 5.37	\$ 5.43	\$ 5.90
BX EUR	€ 5.09	€ 5.42	€ 5.00
C	\$ 11.11	\$ 11.23	\$ 12.20
C2	\$ 17.52	\$ 17.13	\$ 17.69
C2 EUR	€ 16.57	€ 17.05	€ 14.98
C2X	N/A	N/A	\$ 17.53
CX	\$ 5.37	\$ 5.43	\$ 5.90
I	\$ 11.09	\$ 11.22	\$ 12.19
I EUR	€ 10.52	€ 11.20	€ 10.32
I2	\$ 19.20	\$ 18.68	\$ 19.10
I2 EUR	€ 18.16	€ 18.59	€ 16.17
I2 EUR H	€ 14.58	€ 14.40	€ 14.93
I2X	N/A	N/A	\$ 11.75
IT EUR H	€ 11.68	€ 11.83	€ 12.89
IX	\$ 5.37	\$ 5.43	\$ 5.90
N2	\$ 15.25	\$ 14.91	\$ 15.42
NT	\$ 11.83	\$ 11.96	\$ 13.00
S	\$ 11.06	\$ 11.19	\$ 12.16
S1	\$ 17.90	\$ 17.40	\$ 17.76
S1 AUD H (2)	AUD 104.12	N/A	N/A
S1 EUR	€ 16.93	€ 17.32	€ 15.04
S1 EUR H	€ 95.46	€ 94.16	€ 97.54
S1 JPY	¥ 12,836.00	¥ 12,733.00	¥ 10,291.00

	Mortgage Income Portfolio		
	28. Februar 2023 (ungeprüft)	31. August 2022	31. August 2021
S1X	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>\$ 5.90</u>
SA	<u>\$ 72.53</u>	<u>\$ 73.40</u>	<u>\$ 79.92</u>

[^] Der NAV und der NAV je Aktie entsprechen dem veröffentlichten NAV und dem veröffentlichten NAV je Aktie einschließlich etwaiger Anpassungen am Ende des Berichtszeitraums.

- (1) Aufgelöst am 30. November 2022 mit einem abschließenden NAV von SGD28.02
- (2) Auflegungsdatum 7. Oktober 2022
- (3) Aufgelöst am 30. November 2022 mit einem abschließenden NAV von \$13.08
- (4) Aufgelöst am 30. Dezember 2022 mit einem abschließenden NAV von AUD10.97
- (5) Aufgelöst am 30. November 2022 mit einem abschließenden NAV von HKD102.27
- (6) Aufgelöst am 30. Dezember 2022 mit einem abschließenden NAV von NZD11.57
- (7) Aufgelöst am 30. November 2022 mit einem abschließenden NAV von AUD6.89
- (8) Aufgelöst am 31. Oktober 2022 mit einem abschließenden NAV von HKD23.48
- (9) Aufgelöst am 31. Oktober 2022 mit einem abschließenden NAV von NZD9.13
- (10) Aufgelöst am 16. Dezember 2022 mit einem abschließenden NAV von €9.31
- (11) Auflegungsdatum 5. Oktober 2022
- (12) Aufgelöst am 30. November 2022 mit einem abschließenden NAV von HKD173.45
- (13) Aufgelöst am 3. Januar 2023 mit einem abschließenden NAV von \$9.15
- (14) Aufgelöst am 30. Dezember 2022 mit einem abschließenden NAV von AUD8.69
- (15) Aufgelöst am 30. Dezember 2022 mit einem abschließenden NAV von AUD10.70
- (16) Aufgelöst am 30. Dezember 2022 mit einem abschließenden NAV von CAD10.55
- (17) Aufgelöst am 30. Dezember 2022 mit einem abschließenden NAV von GBP10.56
- (18) Aufgelöst am 30. Dezember 2022 mit einem abschließenden NAV von HKD50.97
- (19) Aufgelöst am 3. Januar 2023 mit einem abschließenden NAV von NZD10.35
- (20) Aufgelöst am 8. Dezember 2022 mit einem abschließenden NAV von €21.06
- (21) Aufgelöst am 30. Dezember 2022 mit einem abschließenden NAV von AUD9.17
- (22) Aufgelöst am 31. Oktober 2022 mit einem abschließenden NAV von \$9.34
- (23) Aufgelöst am 30. November 2022 mit einem abschließenden NAV von €5.69
- (24) Aufgelöst am 30. November 2022 mit einem abschließenden NAV von AUD12.16
- (25) Aufgelöst am 30. November 2022 mit einem abschließenden NAV von \$12.52
- (26) Aufgelöst am 31. Oktober 2022 mit einem abschließenden NAV von HKD170.98

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

ANMERKUNG A: Allgemeine Informationen

AB FCPI (der „Fonds“) ist ein offener Investmentfonds (*fonds commun de placement*), der gemäß den Gesetzen des Großherzogtums Luxemburg gegründet wurde und gemäß Teil 1 des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 (in der jeweils gültigen Fassung) über Organismen für gemeinsame Anlagen eingetragen ist („das Gesetz von 2010“). Der Fonds wird im Interesse der Mitinhaber (die „Anteilhaber“) von AllianceBernstein (Luxemburg) S.à r.l. (die „Verwaltungsgesellschaft“) verwaltet, einem Unternehmen, das gemäß den Gesetzen des Großherzogtums Luxemburg gegründet wurde und seinen eingetragenen Sitz in Luxemburg hat. Der Fonds erfüllt die Voraussetzungen eines Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) im Sinne von Artikel 1 Absatz 2 der Richtlinie 2009/65/EG vom 13. Juli 2009 in ihrer jeweils gültigen Fassung.

Der Fonds besteht aus getrennten Anlagevermögen mit derzeit 13 aktiven Portefeuilles (einzeln das „Portefeuille“ und zusammengenommen die „Portefeuilles“). Jede Anteilklasse stellt eine Beteiligung an den Anlagewertpapieren sowie anderen

Nettovermögenswerten des entsprechenden Portefeuilles dar. Alle Anteile einer Klasse haben dieselben Rechte in Bezug auf Ausschüttungen und Rücknahmen.

Ab Ende 2019 und auch bis 2023 weitete sich der Ausbruch des neuen Coronavirus, das eine als COVID-19 bekannte Krankheit verursacht, zu einer globalen Pandemie aus. Die zunehmenden Turbulenzen aufgrund der Ausbreitung des Coronavirus und das Potenzial für dauerhafte und erhebliche negative Auswirkungen auf die Weltwirtschaft haben zu einer erhöhten Marktvolatilität geführt, die sich im weiteren Verlauf der Pandemie und ihrer Folgen wiederholen kann.

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft (der „Verwaltungsrat“) wird die Entwicklung der Lage und ihre Auswirkung auf die finanzielle Situation der Portefeuilles weiterhin überwachen und die operativen Pläne entsprechend anpassen, wenn die Lage dies erfordert.

Die folgende Tabelle zeigt den Beginn der Geschäftstätigkeit der einzelnen Portefeuilles sowie die zum 28. Februar 2023 angebotenen Anteilklassen:

AB FCPI-	Geschäftsaufnahme	Angebote Anteilklassen
Dynamic Diversified Portfolio	1. November 2004	A, A EUR, A EUR H, AX, AX EUR, AX SGD, BX, C, C EUR, C EUR H, CX, I, I EUR, I EUR H & IX
Global Equity Blend Portfolio	29. August 2003	A, A EUR, A EUR H, A SGD, B, B SGD, C, C EUR, I, I EUR, S HKD, S1, S1 EUR, S1 GBP & S1 SGD
Global Value Portfolio	31. Mai 2006	A, A EUR, A SGD, A SGD H, AD, AD AUD H, AD CAD H, AD EUR H, AD GBP H, AD HKD, AD ZAR H, B, C, C EUR, I, I EUR, I GBP, I SGD, S, S GBP, S GBP H, S1, S1 AUD H, S1 EUR, S1 GBP & SD
Emerging Markets Growth Portfolio	29. Oktober 1992	A, A AUD H, A EUR, A HKD, A PLN H, A SGD, A SGD H, AD, B, C, C EUR, ED, I, I AUD H, I EUR, N, S1, S1 EUR & S1 GBP
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	27. November 2009	A, A AUD H, A EUR, A HKD, A SGD H, AD, AD AUD H, AD CAD H, AD EUR, AD EUR H, AD GBP H, AD HKD, AD NZD H, AD RMB H, AD ZAR H, AY JPY, BY JPY, C, C EUR, ED, ED AUD H, I, I AUD H, I EUR, I GBP, S, S HKD, S1, S1 EUR & SD
Japan Strategic Value Portfolio	14. Dezember 2005	A, A CZK H, A EUR, A EUR H, A PLN, A SGD, A SGD H, A USD, A USD H, AD, AD AUD H, AD NZD H, AD USD H, AD ZAR H, C, C EUR, C EUR H, C USD, I, I EUR, I EUR H, I SGD, I USD, I USD H, S EUR H, S1 EUR, S1 USD & SD
China Low Volatility Equity Portfolio	31. Januar 2007	A, A EUR, A HKD, A PLN H, AD, AD AUD H, AD CAD H, AD EUR H, AD GBP H, AD HKD, AD NZD H, AD SGD H, AD ZAR H, B, B EUR, C, C EUR, I, I EUR, S, S1 & S1 EUR

AB FCPI-	Geschäftsaufnahme	Angebote Anteilklassen
Short Duration Bond Portfolio	13. September 1996	A, A EUR, A2, A2 EUR, A2 EUR H, A2 HKD, AA, AA AUD H, AA CAD H, AA GBP H, AA HKD, AA SGD H, AJ, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT EUR, AT EUR H, AT GBP H, AT HKD, AT NZD H, AT SGD H, AX, B, C, C2, C2 EUR H, I, I EUR, I2, I2 EUR, I2 EUR H, IT, N2, NT, S, S1 2, S1 2 EUR & SA
Global High Yield Portfolio	19. September 1997	A, A EUR, A2, A2 CHF H, A2 EUR, A2 EUR H, A2 HKD, A2 PLN H, A2 SGD, A2 SGD H, AA, AA AUD H, AA CAD H, AA EUR H, AA GBP H, AA HKD, AA NZD H, AA RMB H, AA SGD H, AA ZAR H, AK, AK EUR, AK EUR H, AR EUR H, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT EUR, AT EUR H, AT GBP H, AT HKD, AT NZD H, AT RMB H, AT SGD, AT SGD H, B, B2, BT, BT AUD H, C, C EUR, C2, C2 EUR, C2 EUR H, CK, CK EUR H, CT, EA, EA AUD H, EA ZAR H, I, I EUR, I2, I2 AUD H, I2 CHF H, I2 EUR, I2 EUR H, I2 SGD, I2 SGD H, IA AUD H, IQD, IT, IT AUD H, IT CAD H, IT EUR H, IT GBP H, IT HKD, IT RMB H, J, N2, NT, S1, S1 EUR, S1D, S1D2, SA, SHK, SK, W, W EUR, W2, W2 CHF H, W2 EUR H, WT, WT AUD H, WT CAD H, WT EUR H, WT GBP H & WT RMB H
American Income Portfolio	30. Juni 1993	A, A EUR, A2, A2 CHF H, A2 DUR PH, A2 EUR, A2 EUR H, A2 HKD, A2 PLN H, A2 SGD, A2 SGD H, AA, AA AUD H, AA CAD H, AA DUR PH, AA EUR H, AA GBP H, AA HKD, AA NZD H, AA RMB H, AA SGD H, AA ZAR H, AK, AK EUR, AK EUR H, AR EUR, AR EUR H, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT DUR PH, AT EUR, AT EUR H, AT GBP H, AT HKD, AT NZD H, AT RMB H, AT SGD, AT SGD H, B, B2, BT, C, C EUR, C2, C2 DUR PH, C2 EUR, C2 EUR H, CT, EA, EA AUD H, EA ZAR H, I, I EUR, I2, I2 AUD H, I2 CHF H, I2 DUR PH, I2 EUR, I2 EUR H, I2 HKD, I2 SGD, I2 SGD H, IA, IA AUD H, IT, IT AUD H, IT CAD H, IT EUR H, IT GBP H, IT HKD, IT JPY, IT JPY H, IT NZD H, IT RMB H, IT SGD, IT SGD H, J, L2, LT, N2, NT, S, S1, S1D, S1D2, SA, SHK, W, W2, W2 CHF H, W2 EUR H, WT, WT AUD H, WT EUR H, WT GBP H, WT HKD & WT SGD H

AB FCPI-	Geschäftsaufnahme	Angeborene Anteilklassen
European Income Portfolio	25. Februar 1999	A, A USD, A2, A2 CHF H, A2 PLN H, A2 USD, A2 USD H, AA, AA AUD H, AA HKD H, AA RMB H, AA SGD H, AA USD H, AK, AR, AT, AT AUD H, AT SGD H, AT USD, AT USD H, B USD, B2, B2 USD, C, C USD, C2, C2 USD, C2 USD H, CK, CT USD H, I, I USD, I2, I2 AUD H, I2 CHF H, I2 USD, I2 USD H, IA, IA HKD H, IA SGD H, IA USD H, IT, IT SGD H, IT USD H, NT USD H, S1, S1 USD, S1 USD H, S1D, SA USD H, SHK, W2, W2 CHF H, W2 USD H, WA, WA HKD H, WA USD H, WT, WT SGD H & WT USD H
Emerging Markets Debt Portfolio	22. März 2006	A, A EUR, A2, A2 CHF H, A2 EUR, A2 EUR H, A2 HKD, A2 PLN, A2 PLN H, A2 SGD H, AA, AA AUD H, AA CAD H, AA EUR H, AA GBP H, AA HKD, AA NZD H, AA RMB H, AA SGD H, AA ZAR H, AI, AI AUD H, AR EUR, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT EUR, AT EUR H, AT GBP H, AT HKD, AT NZD H, AT SGD H, BT, C, C EUR, C2, C2 EUR, C2 EUR H, CT, EA, EA AUD H, EA ZAR H, EI, EI AUD H, I, I2, I2 AUD H, I2 CHF H, I2 EUR, I2 EUR H, IT AUD H, IT EUR H, N2, NT, S, S1 2, S1 2 EUR, S1 EUR H, S1 GBP H & SA
Mortgage Income Portfolio	26. September 1994	A, A2, A2 EUR, A2 HKD, A2 SGD, A2X, A2X EUR, AA, AA AUD H, AA HKD, AA RMB H, AA SGD H, AA ZAR H, AR EUR H, AT, AT AUD H, AT EUR, AT GBP H, AT HKD, AT SGD, AT SGD H, AX, AX EUR, BX, BX EUR, C, C2, C2 EUR, CX, I, I EUR, I2, I2 EUR, I2 EUR H, IT EUR H, IX, N2, NT, S, S1, S1 AUD H, S1 EUR, S1 EUR H, S1 JPY & SA

ANMERKUNG B: Relevante Bilanzierungsgrundsätze

Dieser Abschluss wurde gemäß den in Luxemburg geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Vorschriften und auf der Grundlage der Unternehmensfortführung erstellt. Es folgt eine Zusammenfassung der relevanten Bilanzierungsgrundsätze der Portefeuilles.

1. Bewertung**1.1 Anlagen in Wertpapiere**

An einer Börse notierte oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere werden zum zuletzt verfügbaren Kurs an dieser Börse bzw. diesem Markt oder, wenn dieser Kurs nicht verfügbar ist, zum Mittelwert aus dem an dem entsprechenden Tag notierten Geld- und Briefkurs bewertet. Wenn ein Wertpapier an mehreren Börsen oder Märkten notiert ist, wird der zuletzt verfügbare Kurs an der Börse bzw. dem Markt, die/der den Primärmarkt für dieses Wertpapier darstellt, zugrunde gelegt.

Außerbörslich gehandelte Wertpapiere, einschließlich Wertpapieren, die an einer Börse notiert sind, deren Primärmarkt als außerbörslich betrachtet wird (jedoch mit Ausnahme von Wert-

papieren, die am Nasdaq Stock Market, Inc. („NASDAQ“) gehandelt werden), werden mit dem Mittelwert der aktuellen Geld- und Briefkurse bewertet. An der NASDAQ gehandelte Wertpapiere werden gemäß dem offiziellen NASDAQ-Schlusskurs bewertet.

Wertpapiere werden zu ihrem aktuellen Marktwert auf Basis der Marktnotierungen oder, wenn keine Marktnotierungen verfügbar sind oder diese als unzuverlässig gelten, zum „angemessenen Marktwert“ entsprechend den Verfahren bewertet, die vom und unter der allgemeinen Aufsicht des Verwaltungsrats festgelegt werden. Angemessene Bewertungsverfahren sollen die Schlusskurse der Wertpapiere des Portefeuilles so berichtigen, dass sie den zum Bewertungszeitpunkt des Portefeuilles als angemessen erachteten Wert jener Wertpapiere widerspiegeln.

Wenn hinsichtlich eines bestimmten Portefeuille-Wertpapiers Verfahren zur Ermittlung des angemessenen Werts eingesetzt werden, können eine Reihe objektiver und subjektiver Faktoren berücksichtigt werden, darunter z. B. Entwicklungen seit der letzten Kursnotierung des Wertpapiers, die sich auf das

Wertpapier bzw. auf einen gesamten Markt auswirken, aktuelle Bewertungen entsprechender Aktienindizes oder Äußerungen bestimmter Regierungsbehörden. Soweit verfügbar, können die angemessenen Werte verwendet werden, die von den Bewertungsmodellen dritter Händler ermittelt werden. Wenn Verfahren zur Ermittlung des angemessenen Werts eingesetzt werden, können die Kurse einzelner Portefeuille-Wertpapiere, die zur Berechnung des Nettoinventarwerts („NAV“) des Portefeuilles verwendet werden, daher von den notierten oder veröffentlichten Kursen derselben Wertpapiere abweichen. Derzeit werden Marktwertanpassungen nur bei bestimmten Aktienwerten und Terminkontrakten vorgenommen.

Dementsprechend kann der Preis eines Portefeuille-Wertpapiers, der durch Verfahren zur Ermittlung des angemessenen Werts ermittelt wurde, genau wie ein früher notierter Börsenkurs bedeutend von dem Preis abweichen, der beim Verkauf dieses Wertpapiers erzielt wurde.

Im Hinblick auf Portefeuille-Wertpapiere, die vorwiegend an US-Börsen gehandelt werden, wird erwartet, dass Verfahren zur Ermittlung des angemessenen Werts nur unter sehr eingeschränkten Umständen eingesetzt werden, z. B. wenn eine Börse, an der ein bestimmtes Wertpapier gehandelt wird, frühzeitig geschlossen wird oder wenn der Handel mit einem bestimmten Wertpapier ausgesetzt wird. Es wird jedoch erwartet, dass Verfahren zur Ermittlung des angemessenen Werts im Hinblick auf Wertpapiere, die an Börsen außerhalb der USA oder anderen Märkten gehandelt werden, insbesondere an europäischen und asiatischen Märkten, mit Ausnahme von Indien, regelmäßig eingesetzt werden, da diese Märkte u. a. weit vor dem Bewertungszeitpunkt des Portefeuilles schließen. Zwischen dem Schließen dieser Märkte und dem jeweiligen Bewertungszeitpunkt des Portefeuilles können bedeutende Ereignisse, darunter umfassende Marktbewegungen, eintreten. Insbesondere können Ereignisse auf dem US-Markt, die an einem Handelstag nach dem Schließen dieser anderen Märkte eintreten, den Wert der Portefeuille-Wertpapiere beeinflussen. Das Japan Strategic Value Portfolio und das Asia Ex-Japan Equity Portfolio verfolgen die Politik, Wertpapiere nur dann zum Marktwert zu bewerten, wenn dies auf Basis der Wertentwicklung der Benchmark und der relativen Aktienkapitalflüsse relevant erscheint.

Rententitel (i), Wertpapiere, die an keiner Börse notiert sind oder an keinem geregelten Markt gehandelt werden (ii), und Wertpapiere, die an einer Börse oder einem geregelten Markt nur sehr schwach gehandelt werden (iii), werden zum letzten Angebotskurs bewertet, der von den Hauptmarktmachern bereitgestellt wird. Ist ein solcher Marktkurs nicht verfügbar oder entspricht ein solcher Marktkurs nicht dem angemessenen Marktwert eines Wertpapiers, wird das Wertpapier auf eine Weise bewertet, die entsprechend den Verfahren, die vom und unter der allgemeinen Aufsicht des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden, den angemessenen Wert widerspiegelt.

US-Staatstitel und alle anderen Schuldinstrumente, die eine Restlaufzeit von 60 Tagen oder weniger besitzen, werden im Allgemeinen von einem unabhängigen Kursdienst zum Marktwert bewertet, sofern ein Marktpreis zur Verfügung steht. Wenn kein Marktpreis zur Verfügung steht, werden die Wertpapiere zu den fortgeführten Anschaffungskosten bewertet. Diese Methode wird häufig für kurzfristige Wertpapiere eingesetzt, die eine ursprüngliche Laufzeit von 60 Tagen oder weniger besitzen, sowie für kurzfristige Wertpapiere, die eine ursprüng-

liche Laufzeit von über 60 Tagen besaßen. In Fällen, in denen die fortgeführten Anschaffungskosten verwendet werden, muss der Bewertungsausschuss (der „Ausschuss“) vernünftigerweise zu dem Schluss kommen, dass die Verwendung der fortgeführten Anschaffungskosten in etwa dem beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers entspricht. Faktoren, die der Ausschuss dabei berücksichtigt, sind insbesondere eine Minderung der Kreditwürdigkeit des Emittenten oder wesentliche Änderungen bei den Zinssätzen. Die Beschlüsse des Ausschusses werden in Übereinstimmung mit Verfahren gefasst, die vom und unter der allgemeinen Aufsicht des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.

Im Freiverkehr gehandelte Swaps („OTC-Swaps“) und andere Derivate werden täglich bewertet, überwiegend unter Rückgriff auf unabhängige Kursdienste, unabhängige Bewertungsmodelle auf der Grundlage von Marktdaten und dritte Broker-Dealer oder Gegenparteien.

1.2 Bewertung von Optionsscheinen

Börsennotierte Optionsscheine werden zu dem von genehmigten Verkäufern bereitgestellten letztverfügbaren Kurs bewertet. Kommt es an dem betreffenden Geschäftstag zu keinem Verkauf, dann wird der Optionsschein zum letztverfügbaren Kurs des Vortages bewertet. An den darauffolgenden Tagen wird das Wertpapier nach bestem Wissen und Gewissen zum angemessenen Marktwert bewertet. Sämtliche nicht börsennotierten Optionsscheine werden nach bestem Wissen und Gewissen zum angemessenen Marktwert bewertet. Sobald ein Optionsschein abgelaufen ist, wird er nicht mehr bewertet.

1.3 Finanzterminkontrakte

Beim Abschluss von Finanzterminkontrakten werden Einschusszahlungen geleistet. Solange der Terminkontrakt offen ist, werden die Veränderungen des Kontraktwerts als unrealisierte Gewinne oder Verluste verbucht, indem täglich Neubewertungen vorgenommen werden, um den Marktwert des Kontrakts am Ende jedes Handelstages widerzuspiegeln. Je nachdem, ob unrealisierte Verluste oder Gewinne erzielt werden, werden Nachschusszahlungen geleistet oder erhalten. Wenn der Kontrakt glattgestellt wird, wird ein realisierter Gewinn oder Verlust verbucht. Dieser realisierte Gewinn oder Verlust entspricht der Differenz zwischen dem Erlös (oder den Kosten) der Glattstellungstransaktion und der Basis des Fonds im Kontrakt.

Offene Terminkontrakte werden anhand des Glattstellungskurses oder, wenn dieser nicht verfügbar ist, anhand des letzten notierten Angebotskurses bewertet. Wenn keine Notierungen für den Bewertungstag vorliegen, wird der letzte verfügbare Glattstellungskurs benutzt.

1.4 Devisentermingeschäfte

Der unrealisierte Gewinn oder Verlust aus offenen Devisentermingeschäften wird als Differenz zwischen dem vertraglich vereinbarten Satz und dem Glattstellungssatz des Kontrakts berechnet. Die realisierten Gewinne oder Verluste beinhalten Nettogewinne oder -verluste aus Devisentermingeschäften, die durch andere Kontrakte mit demselben Kontrahenten beglichen oder verrechnet wurden.

1.5 Gekaufte und verkaufte Optionen

Wenn eine Option gekauft wird, wird ein dem bezahlten Preis entsprechender Betrag als Anlage verbucht und im Folgenden dem aktuellen Marktwert der gekauften Option angepasst.

Der Preis, der für den Kauf von Optionen bezahlt wurde, die verfallen, ohne ausgeübt zu werden, wird am Verfallsdatum als realisierter Verlust verbucht. Wenn eine gekaufte Verkaufsoption ausgeübt wird, wird der Optionspreis vom Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers oder der Fremdwährung abgezogen, um festzustellen, ob das jeweilige Portefeuille einen Gewinn oder Verlust realisiert hat. Wenn eine gekaufte Kaufoption ausgeübt wird, erhöht der Optionspreis die Kostenbasis des Wertpapiers oder der vom jeweiligen Portefeuille gekauften Fremdwährung. Wenn eine Option verkauft wird, wird ein dem erhaltenen Preis entsprechender Betrag als Verbindlichkeit verbucht und im Folgenden dem aktuellen Marktwert der verkauften Option angepasst. Der Preis, der für verkaufte Optionen erhalten wird, die verfallen, ohne ausgeübt zu werden, wird vom jeweiligen Portefeuille am Verfallsdatum als realisierter Gewinn verbucht. Wenn eine verkaufte Kaufoption ausgeübt wird, wird der Preis zum Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers oder der Fremdwährung hinzuaddiert, um festzustellen, ob das jeweilige Portefeuille einen Gewinn oder Verlust realisiert hat. Wenn eine verkaufte Verkaufsoption ausgeübt wird, senkt der Optionspreis die Kostenbasis des vom jeweiligen Portefeuille gekauften Wertpapiers oder der Fremdwährung. Börsennotierte Kauf- und Verkaufsoptionen eines Portefeuilles werden zum letzten Verkaufspreis bewertet. Falls an dem Tag kein Verkauf stattgefunden hat, werden die Wertpapiere zum letzten Rücknahmepreis an dem Tag bewertet.

1.6 Anlagen in anderen Organismen für gemeinsame Anlagen („OGA“)

Anlagen in anderen OGA werden auf Grundlage des letzten verfügbaren NAV des betreffenden OGA bewertet.

1.7 Swap-Vereinbarungen

Für Zwischenzahlungen auf Swap-Kontrakte nehmen die Portefeuilles täglich Rückstellungen innerhalb der Erträge und Aufwendungen vor. Swap-Kontrakte werden täglich zum letzten Börsenkurs bewertet, wobei Wertschwankungen in der Zusammensetzung des Fondsvermögens als „Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung) aus Swaps“ und in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens als „Änderung der unrealisierten Gewinne und (Verluste) aus Swaps“ ausgewiesen werden. Bei Fälligkeit oder Verkauf eines Swap-Kontrakts wird der Nettobetrag in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Realisierte Gewinne und (Verluste) aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ ausgewiesen. Die bezahlten oder erhaltenen Vorabgebühren werden in der Zusammensetzung des Fondsvermögens als Kosten oder Erlöse ausgewiesen und über die Laufzeit des Kontrakts linear abgeschrieben. Aufgelaufene, abgeschriebene Vorabgebühren für Credit-Default-Swaps sind solange im „Swap-Ertrag“ enthalten, bis die Position verkauft wird, danach werden die abgeschriebenen Vorabgebühren unter „Realisierte Gewinne und (Verluste) aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ verbucht. Schwankungen des Werts von Swap-Kontrakten werden als eine Komponente der „Änderung der unrealisierten Gewinne und (Verluste) aus Swaps“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens ausgewiesen.

In der Zusammensetzung des Fondsvermögens ausgewiesene „Für Swap-Kontrakte bezahlte (erhaltene) Vorabgebühren“

enthalten im Freiverkehr für Credit-Default-Swaps bezahlte (erhaltene) Gebühren sowie eine Marge, die noch für die zentral abgerechneten Credit-Default-Swaps beglichen werden muss.

2. Gründungskosten

Die Gründungskosten aller bestehenden Portefeuilles wurden in früheren Jahren vollständig abgeschrieben.

3. Zuteilungsmethode

Die Erträge und Aufwendungen (mit Ausnahme der klassenspezifischen Verwaltungs- und Vertriebsgebühren) der „Renten“- und „Misch“-Portefeuilles werden täglich auf Basis einer „gemischten Zuteilungs-Rechnung“ zugewiesen. Diese Zuteilungs-Rechnung basiert auf dem prozentualen Verhältnis zwischen dem Wert der abgerechneten Anteile einer Anteilklasse mit täglicher Feststellung einer Ausschüttung und dem Wert der umlaufenden Anteile, die entweder auf monatlicher Basis Ausschüttungen ausbezahlen oder keine Ausschüttungen tätigen. Erträge und Aufwendungen der „Aktien“-Portefeuilles des Fonds werden täglich auf Basis ihres prozentualen Verhältnisses nach dem Wert ihrer umlaufenden Anteile zugewiesen. Für alle Portefeuilles werden die realisierten und unrealisierten Gewinne und Verluste des Fonds täglich auf Basis ihres prozentualen Verhältnisses nach dem Wert ihrer umlaufenden Anteile zugewiesen. Klassenspezifische Verwaltungs-, Verwaltungsgesellschafts- und Vertriebsgebühren sowie unrealisierte Gewinne und Verluste aus Devisentermingeschäften, die sich auf die währungsabgesicherten Anteilklassen beziehen, werden der jeweiligen Anteilklasse direkt berechnet/zugewiesen.

Aufgrund des stark institutionellen Charakters aller Arten von Anteilen der Klasse S der Portefeuilles werden bestimmte Kosten des Fonds auf Grundlage der minimalen Aktivität der Anteilinhaber und Anforderungen des Kontostandes ggf. den entsprechenden Anteilen der Klasse S zugewiesen.

4. Währungsumrechnung

Werte, die in einer anderen Währung ausgedrückt sind als der Währung, in der das Portefeuille laut Vertragsbedingungen denominiert ist, werden unter Anwendung des Mittelwerts zwischen dem letzten erhältlichen Kauf- und Verkaufspreis umgerechnet. Transaktionen in Fremdwährungen werden zu dem am Transaktionsdatum geltenden Wechselkurs in die Währung des jeweiligen Portefeuilles umgerechnet.

Die kombinierte Zusammensetzung des Fondsvermögens wird in US-Dollar zu dem am Datum der kombinierten Zusammensetzung des Fondsvermögens geltenden Wechselkursen dargestellt, während die kombinierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens in US-Dollar zu den durchschnittlichen, während des Berichtszeitraums geltenden Wechselkursen dargestellt wird.

Dem Halbjahresabschluss wurden folgende Kurse zugrunde gelegt: Kassakurs von 1.0577 und Mittelkurs von 1.0332 für die Umrechnung von EUR in USD, Kassakurs von 0.0073 und Mittelkurs von 0.0072 für die Umrechnung von JPY in USD.

Die in der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens ausgewiesene „Anpassung aus Währungsumrechnung“ ergibt sich aus den unterschiedlichen Wechselkursen, die zur Umrechnung des kombinierten Nettovermögens zu Beginn des Jahres, der kombinierten Zusammensetzung des Fondsvermögens und der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens verwendet wurden.

5. Anlagerträge und Anlagetransaktionen

Dividendenerträge werden am Tag der Notierung ex Dividende verbucht. Zinserträge werden tagesgenau verbucht. Die Anlagegewinne und -verluste für die Portefeuilles werden anhand der durchschnittlichen Kostenbasis festgestellt.

Der Fonds verbucht Disagios und amortisiert Prämien als Wertberichtigungen der Zinserträge. Anlagegeschäfte werden am Transaktionstag zuzüglich eines Tages verbucht.

6. Schätzungen

Bei der Erstellung des Abschlusses im Einklang mit den in Luxemburg allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen muss die Fondsverwaltung Schätzungen und Annahmen erstellen, die sich auf den Betrag der berichteten Aktiva und Passiva und die Offenlegung der Eventualaktiva und -passiva zum Zeitpunkt des Halbjahresabschlusses sowie die berichteten Einnahmen und Auslagen während des Berichtszeitraums auswirken. Die tatsächlichen Ergebnisse können von diesen Schätzungen abweichen.

7. Swing Pricing-Anpassung

(Die folgenden Ausführungen gelten für alle Portefeuilles, mit Ausnahme des Global Equity Blend Portfolio, des Global Value Portfolio und Short Duration Bond Portfolio)

Die Verwaltungsgesellschaft hat allen Anteilhabern des Fonds mitgeteilt, dass mit Wirkung vom 2. November 2015 eine Richtlinie zur Anpassung des Nettoinventarwerts (NAV) eingeführt wird, die auch als „Swing Pricing“ bekannt ist. Gemäß dieser Richtlinie kann der NAV eines Portefeuilles angepasst werden, um die Auswirkungen der geschätzten Transaktionskosten, Preisabschläge und Gebühren, die durch die Kauf- und Rücknahmeaktivitäten der Anteilhaber entstehen, widerzuspiegeln. Swing Pricing kommt automatisch zur Anwendung, wenn die täglichen Nettozeichnungen oder -rücknahmen einen Schwellenwert überschreiten, der vom Swing-Pricing-Komitee unter Aufsicht des Verwaltungsrats festgelegt wurde. Wenn Swing Pricing zur Anwendung kommt, wird der NAV der Anteile des jeweiligen Portefeuilles um einen Betrag nach oben oder unten korrigiert, der im Allgemeinen höchstens 2% des jeweiligen NAV entspricht, so dass die Transaktionskosten, die

aufgrund der Kauf- und Rücknahmeaktivität entstehen, nicht vom Portefeuille selbst, sondern von den Anlegern getragen werden, die mit den Portefeuilleanteilen handeln. Diese Anpassung soll die Verwässerung des Werts der Anteilhaber-Investitionen in Anteile eines Portefeuilles, die durch Transaktionen mit Portefeuilleanteilen hervorgerufen wird, minimieren.

Die jüngsten und beispiellosen Bedingungen an den Finanzmärkten im Zusammenhang mit der COVID-19-Krise führten zu einer Weitung der Geld-Brief-Spannen bei bestimmten Wertpapieren und folglich zu höheren Transaktionskosten für den Fonds. Das Swing-Pricing-Komitee ist der Ansicht, dass die aktuellen allgemeinen Swing-Pricing-Schwellenwerte von bis zu 2% für den Fonds möglicherweise die erwarteten Kosten im Zusammenhang mit den Preisen für die Handelsabwicklung nicht angemessen widerspiegeln und daher die Interessen der Anteilhaber des Fonds im Falle von Rücknahme- und Zeichnungsaktivitäten möglicherweise nicht vollständig schützen. Der Verwaltungsrat hat im Einklang mit den „CSSF-FAQ zum Swing-Pricing-Mechanismus“ beschlossen, dem Swing-Pricing-Komitee die Möglichkeit einzuräumen, über den Schwellenwert für Swing Pricing hinauszugehen, je nachdem, wie es dies für die Portefeuilles für angemessen hält, um sicherzustellen, dass die übrigen Anteilhaber des Fonds nicht von den derzeitigen Transaktionskosten im Zusammenhang mit der COVID-19-Krise in Mitleidenschaft gezogen werden.

Der in den statistischen Informationen offengelegte NAV je Anteil und das Gesamtvermögen sind der veröffentlichte NAV je Anteil und das Gesamtvermögen, wohingegen das in der Zusammensetzung des Fondsvermögens sowie in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens ausgewiesene Gesamtvermögen der Gesamt-NAV ohne Swing-Anpassungen zum Ende eines Berichtszeitraums ist.

Alle Portefeuilles, die dem „Swing Pricing“ unterliegen, mit Ausnahme des European Income Portfolio und des Emerging Markets Debt Portfolio, haben im Berichtszeitraum den Swing-Pricing-Mechanismus auf den jeweiligen NAV angewandt. Zum 28. Februar 2023, hat das folgende Portefeuille den Swing-Pricing-Mechanismus auf den NAV angewandt:

- China Low Volatility Equity Portfolio.

ANMERKUNG C: Steuern

Als Luxemburger *fonds commun de placement* (offener Investmentfonds) unterliegt der Fonds in Luxemburg nach den derzeit geltenden Steuergesetzen keiner Einkommen-, Quellen- oder Kapitalertragsteuer. Der Fonds unterliegt der Luxemburger *taxe d'abonnement* von 0.05% pro Jahr, die vierteljährlich auf Grundlage des Gesamtvermögens am letzten Tag jedes Quartals errechnet und entrichtet wird. Der Satz liegt bei 0.01% für Anteilklassen, die institutionellen Anlegern vorbehalten

sind, wie gemäß Artikel 174 des Gesetzes von 2010 definiert. Auf Zinsen, Dividenden und Kursgewinne aus Wertpapieren werden unter Umständen in gewissen Ländern Quellen- oder Kapitalertragsteuern erhoben.

Im Zusammenhang mit einer Anlage eines Portefeuilles in einem separaten Portefeuille wird der Betrag der *taxe d'abonnement*, der dem Anteil des Portefeuilles an der innerhalb der jeweiligen Anteilklasse des separaten Portefeuilles anfallenden *taxe d'abonnement* entspricht, erlassen.

ANMERKUNG D: Ausschüttungen

Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt derzeit nicht, auf die Anteile des Global Equity Blend Portfolio Dividenden auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widerspiegelt.

Für das Dynamic Diversified Portfolio:

- Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft,

Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Ausschüttungen können aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Ausschüttungen, die die Nettoerträge (Bruttoerträge abzüglich Gebühren und Aufwendungen) übersteigen, könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

- Für Anteile der Klassen A, C, I, S, S1, SP, S1P, AX, BX, CX und IX (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.

Für das Global Value Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, S, S1, SA GB, SB GB, S1A GB und S1B GB (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen AD und SD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Ausschüttungen, die die Nettoerträge (Bruttoerträge abzüglich Gebühren und Aufwendungen) übersteigen, könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das Emerging Markets Growth Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, N, S, S1 und W (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen AD und ED (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Ausschüttungen, die die Nettoerträge (Bruttoerträge abzüglich Gebühren und Aufwendungen) übersteigen, könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das Asia Ex-Japan Equity Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, C, I, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen AY und BY kann die Verwaltungsgesellschaft im eigenen Ermessen auf Grundlage der Netto-

erträge, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind, Dividenden erklären und ausschütten.

- Für Anteile der Klassen AD, ED, ID und SD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Ausschüttungen, die die Nettoerträge (Bruttoerträge abzüglich Gebühren und Aufwendungen) übersteigen, könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das Japan Strategic Value Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, C, I, S, S1 und 2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen AD und SD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Ausschüttungen, die die Nettoerträge (Bruttoerträge abzüglich Gebühren und Aufwendungen) übersteigen, könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das China Low Volatility Equity Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, S und S1 beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im jeweiligen NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen AD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Ausschüttungen, die die Nettoerträge (Bruttoerträge abzüglich Gebühren und Aufwendungen) übersteigen, könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das Short Duration Bond Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, AX, B, C, I, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H, sofern nicht anders angegeben) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AJ, AT, CT, IT und NT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.
- Für Anteile der Klassen A2, C2, I2, N2, S2 und S1 2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) und Anteile der Klassen S EUR H, S1 EUR H und S SGD H beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.

Für das Global High Yield Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, JA, J und W (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AT, BT, CT, IT, NT, S1D, S1D2 und WT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen IQD und S1QD beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind. Für Anteile der Klasse SK kann die Verwaltungsgesellschaft nach ihrem Ermessen Dividenden erklären und ausschütten.

- Für Anteile der Klassen AK und CK (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden zweimal jährlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA, EA, IA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Für Anteile der Klasse SHK beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, die Ausschüttungen täglich zu erklären und monatlich vorzunehmen. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.
- Für Anteile der Klassen A2, B2, C2, I2, N2, S, S1 und W2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.

Für das American Income Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, JA, J und W (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AT, BT, CT, IT, LT, NT, S1D, S1D2, WT und ZT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H und Klasse DUR PH) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AK und CK (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden zweimal jährlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA, EA, IA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H und Klasse DUR PH) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Für Anteile der Klasse SHK (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, die Ausschüttungen täglich zu erklären und auszuschütten.

erklären und monatlich vorzunehmen. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

- Für Anteile der Klasse S1QD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen A2, B2, C2, I2, L2, N2, S, S1 und W2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H und Klasse DUR PH) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widerspiegelt.

Für das European Income Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C und I beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AT, CT, IT, NT, S1D und WT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AK und CK beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden zweimal jährlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA, IA, SA und WA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Für Anteile der Klasse SHK (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, die Ausschüttungen täglich zu erklären und monatlich vorzunehmen. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können

auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

- Für Anteile der Klassen A2, B2, C2, I2, S, S1 und W2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widerspiegelt.

Für das Emerging Markets Debt Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, C und I (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AT, BT, CT, IT, NT und ZT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA, EA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.
- Für Anteile der Klassen AI und EI (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Ausschüttungen können aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und möglicherweise in erheblichem Umfang aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Ausschüttungen, die die Nettoerträge (Bruttoerträge abzüglich Gebühren und Aufwendungen) übersteigen, könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren. Falls der Nettoinventarwert je Anteil unter 1 USD bzw. 1 AUD fällt, wird die Verwaltungsgesellschaft in ihrem alleinigen Ermessen erwägen, entweder (i) die Anteilklasse umzustrukturieren, auch durch die Zusammenlegung mit einer Anteilklasse mit

ähnlichen Merkmalen, oder (ii) die Anteilklasse zu liquidieren. Dividenden können auf Wunsch der Anteilinhaber automatisch wiederangelegt werden.

- Für Anteile der Klassen A2, C2, I2, N2, S, S1 und S1 2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klasse S1QD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.

Für das Mortgage Income Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, AX, BX, C, CX, I, IX, S und S1X beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AT, ATX, IT, NT und ZT beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA, EA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwal-

tungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen I um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

- Für Anteile der Klassen A2, A2X, C2, C2X, I2, I2X, N2, S1 und S2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.

Die Verwaltungsgesellschaft kann außerdem festlegen, ob und in welchem Maße die bezahlten Dividenden realisierte Kapitalgewinne beinhalten und/oder aus dem Kapital bezahlt werden, das der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen ist. Soweit die Nettoerträge und die realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuweisen sind, den auszuschüttenden Betrag übersteigen, wird die überschüssige Rendite im jeweiligen Nettoinventarwert dieser Anteile widergespiegelt. Dividenden können auf Wunsch der Anteilinhaber automatisch wiederangelegt werden.

ANMERKUNG E: Verwaltungsgebühren und andere Transaktionen mit verbundenen Unternehmen

Der Fonds zahlt der Verwaltungsgesellschaft eine Verwaltungsgebühr. Gemäß den Bedingungen des Anlagevertrags zahlt die Verwaltungsgesellschaft AllianceBernstein L.P. (der „Anlageverwalter“) aus der erhaltenen Verwaltungsgebühr eine Anlageverwaltungsgebühr.

Die Verwaltungsgesellschaft hat sich freiwillig bereit erklärt, bestimmte Aufwendungen zu tragen, soweit dies erforderlich ist, um die Gesamtbetriebskosten auf jährlicher Basis zu beschränken.

Diese Beschränkungen wurden wie folgt festgesetzt (die Beschränkungen sind als Prozentsatz des tagesdurchschnittlichen Nettovermögens ausgedrückt):

AB FCPI-	Anteilklasse	%
Dynamic Diversified		
Portfolio	Klasse A	1.95%
	Klasse A EUR	1.95%
	Klasse A EUR H	1.95%
	Klasse AX	1.90%
	Klasse AX EUR	1.90%
	Klasse AX SGD	1.90%
	Klasse BX	2.90%
	Klasse BX SGD(a)	2.90%
	Klasse C	2.25%

AB FCPI-	Anteilklasse	%
Dynamic Diversified		
Portfolio (Fortsetzung) . . .	Klasse C EUR	2.25%
	Klasse C EUR H	2.25%
	Klasse CX	2.20%
	Klasse I	1.25%
	Klasse I EUR	1.25%
	Klasse I EUR H	1.25%
	Klasse IX	1.20%
Global Equity Blend		
Portfolio	Klasse A	2.10%
	Klasse A EUR	2.10%
	Klasse A EUR H	2.10%
	Klasse A SGD	2.10%
	Klasse B	3.10%
	Klasse B SGD	3.10%
	Klasse C	2.55%
	Klasse C EUR	2.55%
	Klasse I	1.30%
	Klasse I EUR	1.30%
	Klasse S HKD	0.10%
	Klasse S1	0.80%
	Klasse S1 EUR	0.80%
	Klasse S1 GBP	0.80%
	Klasse S1 SGD	0.80%

AB FCPI-	Anteilklasse	%	AB FCPI-	Anteilklasse	%
Global Value Portfolio	Klasse S	0.12%	Japan Strategic Value Portfolio (Fortsetzung) . . .	Klasse A USD H	1.70%
	Klasse S GBP	0.12%		Klasse AD	1.70%
	Klasse S GBP H	0.12%		Klasse AD AUD H	1.70%
	Klasse S1	0.82%		Klasse AD NZD H	1.70%
	Klasse S1 AUD H	0.82%		Klasse AD USD H	1.70%
	Klasse S1 EUR	0.82%		Klasse AD ZAR H	1.70%
	Klasse S1 GBP	0.82%		Klasse C	2.60%
Klasse SD	0.12%	Klasse C EUR		2.60%	
Emerging Markets Growth Portfolio	Klasse S1	1.20%		Klasse C EUR H	2.60%
	Klasse S1 EUR	1.20%		Klasse C USD	2.60%
	Klasse S1 GBP	1.20%		Klasse I	0.90%
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	Klasse A	2.05%		Klasse I EUR	0.90%
	Klasse A AUD H	2.05%		Klasse I EUR H	0.90%
	Klasse A EUR	2.05%	Klasse I SGD	0.90%	
	Klasse A HKD	2.05%	Klasse I USD	0.90%	
	Klasse A SGD H	2.05%	Klasse I USD H	0.90%	
	Klasse AD	2.05%	Klasse S EUR H	0.15%	
	Klasse AD AUD H	2.05%	Klasse S1 EUR	0.80%	
	Klasse AD CAD H	2.05%	Klasse S1 USD	0.80%	
	Klasse AD EUR	2.05%	Klasse SD	0.15%	
	Klasse AD EUR H	2.05%	China Low Volatility Equity Portfolio	Klasse A	1.99%
	Klasse AD GBP H	2.05%		Klasse A EUR	1.99%
	Klasse AD HKD	2.05%		Klasse A HKD	1.99%
	Klasse AD NZD H	2.05%		Klasse A PLN H	1.99%
	Klasse AD RMB H	2.05%		Klasse AD	1.99%
	Klasse AD ZAR H	2.05%		Klasse AD AUD H	1.99%
	Klasse AY JPY	2.05%		Klasse AD CAD H	1.99%
	Klasse BD(a)	3.05%		Klasse AD EUR H	1.99%
	Klasse BD AUD H(b)	3.05%		Klasse AD GBP H	1.99%
	Klasse BD HKD(a)	3.05%		Klasse AD HKD	1.99%
	Klasse BY JPY	2.52%		Klasse AD NZD H	1.99%
	Klasse C	2.50%		Klasse AD SGD H	1.99%
	Klasse C EUR	2.50%		Klasse AD ZAR H	1.99%
	Klasse ED	3.05%	Klasse B	2.99%	
	Klasse ED AUD H	3.05%	Klasse B EUR	2.99%	
	Klasse I	1.25%	Klasse BD NZD H(b)	2.99%	
	Klasse I AUD H	1.25%	Klasse C	2.44%	
	Klasse I EUR	1.25%	Klasse C EUR	2.44%	
	Klasse I GBP	1.25%	Klasse I	1.19%	
	Klasse S	0.30%	Klasse I EUR	1.19%	
Klasse S HKD	0.30%	Klasse S	0.16%		
Klasse S1	1.20%	Klasse S1	0.91%		
Klasse S1 EUR	1.20%	Klasse S1 EUR	0.91%		
Klasse SD	0.30%	Short Duration Bond Portfolio	Klasse A	1.20%	
Japan Strategic Value Portfolio	Klasse A		1.70%	Klasse A EUR	1.20%
	Klasse A CZK H		1.70%	Klasse A2	1.20%
	Klasse A EUR		1.70%	Klasse A2 EUR	1.20%
	Klasse A EUR H		1.70%	Klasse A2 EUR H	1.20%
	Klasse A PLN		1.70%	Klasse A2 HKD	1.20%
	Klasse A SGD		1.70%	Klasse AA	1.20%
	Klasse A SGD H		1.70%	Klasse AA AUD H	1.20%
	Klasse A USD	1.70%	Klasse AA CAD H	1.20%	

AB FCPI-	Anteilklasse	%	AB FCPI-	Anteilklasse	%
Short Duration Bond			American Income		
Portfolio (Fortsetzung) . . .	Klasse AA GBP H	1.20%	Portfolio (Fortsetzung) . . .	Klasse AA EUR H	1.50%
	Klasse AA HKD	1.20%		Klasse AA GBP H	1.50%
	Klasse AA SGD H	1.20%		Klasse AA HKD	1.50%
	Klasse AJ	1.00%		Klasse AA NZD H	1.50%
	Klasse AT	1.20%		Klasse AA RMB H	1.50%
	Klasse AT AUD H	1.20%		Klasse AA SGD H	1.50%
	Klasse AT CAD H	1.20%		Klasse AA ZAR H	1.50%
	Klasse AT EUR	1.20%		Klasse AK	1.50%
	Klasse AT EUR H	1.20%		Klasse AK EUR	1.50%
	Klasse AT GBP H	1.20%		Klasse AK EUR H	1.50%
	Klasse AT HKD	1.20%		Klasse AR EUR	1.50%
	Klasse AT NZD H	1.20%		Klasse AR EUR H	1.50%
	Klasse AT SGD H	1.20%		Klasse AT	1.50%
	Klasse AX	1.00%		Klasse AT AUD H	1.50%
	Klasse B	2.20%		Klasse AT CAD H	1.50%
	Klasse C	1.60%		Klasse AT DUR PH	1.50%
	Klasse C2	1.60%		Klasse AT EUR	1.50%
	Klasse C2 EUR H	1.60%		Klasse AT EUR H	1.50%
	Klasse I	0.575%		Klasse AT GBP H	1.50%
	Klasse I EUR	0.575%		Klasse AT HKD	1.50%
	Klasse I2	0.575%		Klasse AT NZD H	1.50%
	Klasse I2 EUR	0.575%		Klasse AT RMB H	1.50%
	Klasse I2 EUR H	0.575%		Klasse AT SGD	1.50%
	Klasse IT	0.575%		Klasse AT SGD H	1.50%
	Klasse N2	1.70%		Klasse B	2.20%
	Klasse NT	1.70%		Klasse B2	2.20%
	Klasse S	0.10%		Klasse B2 HKD(a)	2.20%
	Klasse S1 2	0.35%		Klasse BA(c)	2.20%
	Klasse S1 2 EUR	0.35%		Klasse BA AUD H(b)	2.20%
	Klasse SA	0.10%		Klasse BT	2.20%
Global High Yield				Klasse BT AUD H(b)	2.20%
Portfolio	Klasse S1	1.00%		Klasse BT CAD H(b)	2.20%
	Klasse S1 EUR	1.00%		Klasse BT GBP H(b)	2.20%
	Klasse S1D	1.00%		Klasse BT HKD(b)	2.20%
	Klasse S1D2	1.00%		Klasse BT NZD H(c)	2.20%
	Klasse SA	0.10%		Klasse C	1.95%
	Klasse SHK	0.10%		Klasse C EUR	1.95%
	Klasse SK	0.75%		Klasse C2	1.95%
American Income				Klasse C2 DUR PH	1.95%
Portfolio	Klasse A	1.50%		Klasse C2 EUR	1.95%
	Klasse A EUR	1.50%		Klasse C2 EUR H	1.95%
	Klasse A2	1.50%		Klasse CT	1.95%
	Klasse A2 CHF H	1.50%		Klasse EA	2.00%
	Klasse A2 DUR PH	1.50%		Klasse EA AUD H	2.00%
	Klasse A2 EUR	1.50%		Klasse EA ZAR H	2.00%
	Klasse A2 EUR H	1.50%		Klasse I	0.95%
	Klasse A2 HKD	1.50%		Klasse I EUR	0.95%
	Klasse A2 PLN H	1.50%		Klasse I2	0.95%
	Klasse A2 SGD	1.50%		Klasse I2 AUD H	0.95%
	Klasse A2 SGD H	1.50%		Klasse I2 CHF H	0.95%
	Klasse AA	1.50%		Klasse I2 DUR PH	0.95%
	Klasse AA AUD H	1.50%		Klasse I2 EUR	0.95%
	Klasse AA CAD H	1.50%		Klasse I2 EUR H	0.95%
	Klasse AA DUR PH	1.50%		Klasse I2 HKD	0.95%

AB FCPI-	Anteilklasse	%	AB FCPI-	Anteilklasse	%
American Income			European Income		
Portfolio (Fortsetzung) . . .	Klasse I2 SGD	0.95%	Portfolio (Fortsetzung) . . .	Klasse AT SGD H	1.41%
	Klasse I2 SGD H	0.95%		Klasse AT USD	1.41%
	Klasse IA	0.95%		Klasse AT USD H	1.41%
	Klasse IA AUD H	0.95%		Klasse B USD	2.11%
	Klasse IT	0.95%		Klasse B2	2.11%
	Klasse IT AUD H	0.95%		Klasse B2 USD	2.11%
	Klasse IT CAD H	0.95%		Klasse BA AUD H(b)	2.11%
	Klasse IT EUR H	0.95%		Klasse BA USD H(e)	2.11%
	Klasse IT GBP H	0.95%		Klasse BT(a)	2.11%
	Klasse IT HKD	0.95%		Klasse BT AUD H(a)	2.11%
	Klasse IT JPY	0.95%		Klasse BT USD H(a)	2.11%
	Klasse IT JPY H	0.95%		Klasse C	1.86%
	Klasse IT NZD H	0.95%		Klasse C USD	1.86%
	Klasse IT RMB H	0.95%		Klasse C2	1.86%
	Klasse IT SGD	0.95%		Klasse C2 USD	1.86%
	Klasse IT SGD H	0.95%		Klasse C2 USD H	1.86%
	Klasse L2	1.05%		Klasse CK	1.86%
	Klasse LT	1.05%		Klasse CT USD H	1.86%
	Klasse N2	2.05%		Klasse I	0.86%
	Klasse NT	2.05%		Klasse I USD	0.86%
	Klasse S	0.15%		Klasse I2	0.86%
	Klasse S1	0.65%		Klasse I2 AUD H	0.86%
	Klasse S1 EUR(d)	0.65%		Klasse I2 CHF H	0.86%
	Klasse S1D	0.65%		Klasse I2 USD	0.86%
	Klasse S1D2	0.65%		Klasse I2 USD H	0.86%
	Klasse SA	0.15%		Klasse IA	0.86%
	Klasse SHK	0.15%		Klasse IA HKD H	0.86%
	Klasse W	0.95%		Klasse IA SGD H	0.86%
	Klasse W2	0.95%		Klasse IA USD H	0.86%
	Klasse W2 CHF H	0.95%		Klasse IT	0.86%
	Klasse W2 EUR H	0.95%		Klasse IT SGD H	0.86%
	Klasse WT	0.95%		Klasse IT USD H	0.86%
	Klasse WT AUD H	0.95%		Klasse NT USD H	1.96%
	Klasse WT EUR H	0.95%		Klasse S1	0.65%
	Klasse WT GBP H	0.95%		Klasse S1 USD	0.65%
	Klasse WT HKD	0.95%		Klasse S1 USD H	0.65%
	Klasse WT SGD H	0.95%		Klasse S1D	0.65%
European Income				Klasse SA USD H	0.15%
Portfolio	Klasse A	1.41%		Klasse SHK	0.15%
	Klasse A USD	1.41%		Klasse W2	0.86%
	Klasse A2	1.41%		Klasse W2 CHF H	0.86%
	Klasse A2 CHF H	1.41%		Klasse W2 USD H	0.86%
	Klasse A2 PLN H	1.41%		Klasse WA	0.86%
	Klasse A2 USD	1.41%		Klasse WA HKD H	0.86%
	Klasse A2 USD H	1.41%		Klasse WA USD H	0.86%
	Klasse AA	1.41%		Klasse WT	0.86%
	Klasse AA AUD H	1.41%		Klasse WT SGD H	0.86%
	Klasse AA HKD H	1.41%		Klasse WT USD H	0.86%
	Klasse AA RMB H	1.41%	Emerging Markets Debt		
	Klasse AA SGD H	1.41%	Portfolio	Klasse A	1.50%
	Klasse AA USD H	1.41%		Klasse A EUR	1.50%
	Klasse AK	1.41%		Klasse A2	1.50%
	Klasse AR	1.41%		Klasse A2 CHF H	1.50%
	Klasse AT	1.41%		Klasse A2 EUR	1.50%
	Klasse AT AUD H	1.41%		Klasse A2 EUR H	1.50%

AB FCPI-	Anteilklasse	%	AB FCPI-	Anteilklasse	%
Emerging Markets Debt			Mortgage Income		
Portfolio (Fortsetzung) . . .	Klasse A2 HKD	1.50%	Portfolio	Klasse A	1.50%
	Klasse A2 PLN	1.50%		Klasse A2	1.50%
	Klasse A2 PLN H	1.50%		Klasse A2 EUR	1.50%
	Klasse A2 SGD H	1.50%		Klasse A2 HKD	1.50%
	Klasse AA	1.50%		Klasse A2 SGD	1.50%
	Klasse AA AUD H	1.50%		Klasse A2X	1.25%
	Klasse AA CAD H	1.50%		Klasse A2X EUR	1.25%
	Klasse AA EUR H	1.50%		Klasse AA	1.50%
	Klasse AA GBP H	1.50%		Klasse AA AUD H	1.50%
	Klasse AA HKD	1.50%		Klasse AA HKD	1.50%
	Klasse AA NZD H	1.50%		Klasse AA RMB H	1.50%
	Klasse AA RMB H	1.50%		Klasse AA SGD H	1.50%
	Klasse AA SGD H	1.50%		Klasse AA ZAR H	1.50%
	Klasse AA ZAR H	1.50%		Klasse AR EUR H	1.50%
	Klasse AI	1.50%		Klasse AT	1.50%
	Klasse AI AUD H	1.50%		Klasse AT AUD H	1.50%
	Klasse AR EUR	1.50%		Klasse AT EUR	1.50%
	Klasse AT	1.50%		Klasse AT GBP H	1.50%
	Klasse AT AUD H	1.50%		Klasse AT HKD	1.50%
	Klasse AT CAD H	1.50%		Klasse AT SGD	1.50%
	Klasse AT EUR	1.50%		Klasse AT SGD H	1.50%
	Klasse AT EUR H	1.50%		Klasse AX	1.25%
	Klasse AT GBP H	1.50%		Klasse AX EUR	1.25%
	Klasse AT HKD	1.50%		Klasse BX	1.70%
	Klasse AT NZD H	1.50%		Klasse BX EUR	1.70%
	Klasse AT SGD H	1.50%		Klasse C	1.95%
	Klasse B2 HKD(f)	2.50%		Klasse C2	1.95%
	Klasse BT	2.50%		Klasse C2 EUR	1.95%
	Klasse C	1.95%		Klasse CX	1.70%
	Klasse C EUR	1.95%		Klasse I	0.95%
	Klasse C2	1.95%		Klasse I EUR	0.95%
	Klasse C2 EUR	1.95%		Klasse I2	0.95%
	Klasse C2 EUR H	1.95%		Klasse I2 EUR	0.95%
	Klasse CT	1.95%		Klasse I2 EUR H	0.95%
	Klasse EA	2.00%		Klasse IT EUR H	0.95%
	Klasse EA AUD H	2.00%		Klasse IX	0.70%
	Klasse EA ZAR H	2.00%		Klasse N2	2.05%
	Klasse EI	2.00%		Klasse NT	2.05%
	Klasse EI AUD H	2.00%		Klasse S	0.15%
	Klasse I	0.95%		Klasse S1	0.65%
	Klasse I2	0.95%		Klasse S1 AUD H	0.65%
	Klasse I2 AUD H	0.95%		Klasse S1 EUR	0.65%
	Klasse I2 CHF H	0.95%		Klasse S1 EUR H	0.65%
	Klasse I2 EUR	0.95%		Klasse S1 JPY	0.65%
	Klasse I2 EUR H	0.95%		Klasse SA	0.15%
	Klasse IT AUD H	0.95%			
	Klasse IT EUR H	0.95%			
	Klasse N2	2.05%			
	Klasse NT	2.05%			
	Klasse S	0.15%			
	Klasse S1 2	0.70%			
	Klasse S1 2 EUR	0.70%			
	Klasse S1 EUR H	0.70%			
	Klasse S1 GBP H	0.70%			
	Klasse SA	0.15%			

- (a) Die Anteilklasse wurde am 30. November 2022 aufgelöst.
- (b) Die Anteilklasse wurde am 30. November 2022 aufgelöst.
- (c) Die Anteilklasse wurde am 3. Januar 2023 aufgelöst.
- (d) Die Anteilklasse wurde am 8. Dezember 2022 aufgelöst.
- (e) Die Anteilklasse wurde am 12. Oktober 2022 aufgelöst.
- (f) Die Anteilklasse wurde am 31. Oktober 2022 aufgelöst.

Folgende Tabelle gibt Aufschluss über die von der Verwaltungsgesellschaft getragenen Aufwendungen während des Berichtszeitraums zum 28. Februar 2023 und die Forderungen aus Aufwandserstattung zum 28. Februar 2023:

AB FCPI –	Getragene Aufwendungen	Forderungen aus Aufwands-erstattung
Dynamic Diversified Portfolio . . .	\$ 144,046	23,097
Global Equity Blend Portfolio . . .	\$ 53,182	7,734
Global Value Portfolio	\$ 7	–
Asia Ex-Japan Equity Portfolio . .	\$ 11,043	3,963
Japan Strategic Value Portfolio . .	¥ 23,814,055	3,767,933
China Low Volatility Equity Portfolio	\$ 66,413	8,906
Short Duration Bond Portfolio . . .	\$ 83,379	14,090
American Income Portfolio	\$ 31	5
European Income Portfolio	€ 29	29
Emerging Markets Debt Portfolio	\$ 235	–
Mortgage Income Portfolio	\$ 1,848	306

Die von der Verwaltungsgesellschaft getragenen Aufwendungen werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen“ verbucht. Die Forderungen aus Aufwandserstattung sind in der Zusammensetzung des Fondsvermögens unter „Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten“ ausgewiesen.

Der Fonds zahlt der Verwaltungsgesellschaft außerdem eine Verwaltungsgesellschaftsgebühr.

Bestimmte Anteilsklassen jedes Portefeuilles zahlen der Vertriebsgesellschaft eine Vertriebsgebühr, die eine Vergütung für die Erbringung vertriebsbezogener Dienstleistungen für den Fonds in Bezug auf diese Anteile darstellt.

Alle oben erwähnten Gebühren laufen zu einem Jahressatz des tagesdurchschnittlichen Nettoinventarwertes des jeweiligen Portefeuilles auf und werden monatlich entrichtet.

Die Jahressätze der betreffenden Gebühren für die einzelnen Portefeuilles sind in Tabelle 1 (auf Seite 190 bis 201) aufgeführt.

Ferner unterliegen alle Arten von Anteilen der Klasse B einem Rücknahmeabschlag in Höhe von zwischen 0.00% und 4.50%, alle Arten von Anteilen der Klasse C einem Rücknahmeabschlag in Höhe von zwischen 0.00% und 1.00% und alle Arten von Anteilen der Klasse E einem Rücknahmeabschlag in Höhe von zwischen 0.00% und 3.00%. Anteile der Klasse J unterliegen einem Rücknahmeabschlag in Höhe von zwischen 0.00% und 3.00%. Der tatsächlich berechnete Satz hängt von dem Portefeuille und der Haltedauer der Anteile ab.

Der Fonds zahlt seiner Registrier- und Transferstelle Alliance-Bernstein Investor Services, einem Geschäftsbereich der Verwaltungsgesellschaft, eine Vergütung dafür, dass sie Personal und Räumlichkeiten im Rahmen der Erbringung von Dienstleistungen als Registrier- und Transferstelle des Fonds zur Verfügung stellt. Für den Berichtszeitraum zum 28. Februar 2023 belief sich dieser Betrag auf \$8,907,529.

Der Fonds vergütet dem Anlageverwalter bestimmte Dienstleistungen, die dieser dem Fonds im Zusammenhang mit der

Registrierung des Fonds zum Vertrieb in bestimmten Hoheitsgebieten außerhalb von Luxemburg vorbehaltlich bestimmter Bedingungen erbringt. Für den Berichtszeitraum zum 28. Februar 2023 belief sich dieser Betrag auf \$446,631. Der Betrag ist in der Gebühr für professionelle Dienstleistungen in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens enthalten.

Der Fonds vergütet seinem Rechtsberater Elvinger Hoss Prussen, *société anonyme* (bei dem Yves Prussen, ein Manager der Verwaltungsgesellschaft, bis zum 11. Februar 2022 Partner war) gegenüber dem Fonds erbrachte Rechtsdienste. Für den Berichtszeitraum zum 28. Februar 2023 wurde eine Vergütung in Höhe von €6,604 entrichtet, die in der Gebühr für professionelle Dienstleistungen in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens enthalten ist.

Der Anlageverwalter hat keine Geschäfte bezüglich einer Platzierung und/oder Neuemission abgeschlossen, an der eine verbundene Person als Mitglied des Übernahmekonsortiums wesentlich beteiligt war.

Alle im Namen des Fonds abgeschlossenen Geschäfte wurden im Verlauf der regulären Geschäftstätigkeit und/oder zu den handelsüblichen Bedingungen getätigt. Für den Berichtszeitraum zum 28. Februar 2023 wurden keine Provisionen für Wertpapiertransaktionen unter Beanspruchung der Dienste der Tochtergesellschaften, Sanford C. Bernstein & Co., LLC and Bernstein Autonomous LLP., gezahlt. Mehrere Verwaltungsratsmitglieder des Fonds sind Mitarbeiter und/oder leitende Angestellte des Anlageverwalters und/oder seiner verbundenen Unternehmen.

Das Dynamic Diversified Portfolio investiert in das AB SICAV I – Low Volatility Equity Portfolio, das von der Verwaltungsgesellschaft verwaltet wird. Das Global High Yield Portfolio investiert in das AB SICAV I – Emerging Market Corporate Debt Portfolio, das AB SICAV I – Sustainable Euro High Yield Portfolio, das AB SICAV I – Asia Income Opportunities Portfolio, das AB SICAV I – Emerging Market Local Currency Debt Portfolio, das AB SICAV I – US High Yield Portfolio und das AB SICAV I – Financial Credit Portfolio, die von der Verwaltungsgesellschaft verwaltet werden. Das American Income Portfolio investiert in das AB SICAV I – US High Yield Portfolio, das AB SICAV I – Asia Income Opportunities Portfolio, das AB SICAV I – Global Income Portfolio, das AB SICAV I – Sustainable Income Portfolio und das AB SICAV I – Short Duration Income Portfolio, die von der Verwaltungsgesellschaft verwaltet werden. Das Emerging Markets Debt Portfolio investiert in das AB SICAV I – Emerging Market Corporate Debt Portfolio, das von der Verwaltungsgesellschaft verwaltet wird.

Der Fonds kann Wertpapiere von einem verbundenen Fonds erwerben oder an diesen verkaufen, sofern die Verbindung ausschließlich darin besteht, dass die Fonds einen gemeinsamen Anlageberater, gemeinsame leitende Angestellte oder gemeinsame Verwaltungsratsmitglieder haben. Im Berichtszeitraum gab es keine Kauf- und Verkaufstransaktionen mit einem verbundenen Fonds.

ANMERKUNG F: Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen und Transaktionskosten

Im Berichtszeitraum zum 28. Februar 2023 haben der Anlageverwalter und eventuelle verbundene Unteranlageverwalter,

soweit nach geltendem Recht zulässig, Ausgleichsprovisionen/-vereinbarungen mit Brokern in Bezug auf Portefeuilles des Fonds erhalten bzw. abgeschlossen, die in Aktienwerten anlegen, für welche bestimmte Güter und Dienstleistungen

zur Unterstützung des Anlageentscheidungsprozesses erhalten wurden. Die Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen wurden auf Grundlage der Voraussetzung abgeschlossen, dass die Abwicklung von Transaktionen für den Fonds im Einklang mit den Standards zur bestmöglichen Abwicklung erfolgt und der Anlageverwalter beim Abschluss von Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen zahlreiche Faktoren hinsichtlich der Standards zur bestmöglichen Abwicklung berücksichtigt, wie beispielsweise Umfang und Art der Brokergebühren.

Darüber hinaus können aufgrund der Art der Anlagestrategie bestimmter Portefeuilles, einschließlich der Fälle, in denen der Anlageverwalter Anlageverwaltungsdienstleistungen an AllianceBernstein Limited delegiert, alle Kosten im Zusammenhang mit Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen „entflochten“ und vom Anlageverwalter oder seinen Unterauftragtragen getragen werden, falls dies nach geltendem Recht erforderlich ist.

Die erhaltenen Güter und Dienstleistungen umfassen u. a. spezialisiertes Branchen-, Unternehmens- und Verbraucher-Research, Portefeuille- und Marktanalysen sowie Computersoftware für die Bereitstellung dieser Dienstleistungen.

Die erhaltenen Güter und Dienstleistungen sind von der Art, dass die gemäß dieser Vereinbarung bereitgestellten Leistungen bei der Bereitstellung von Anlagediensten für den Fonds behilflich sind und zur Verbesserung der Wertentwicklung des Fonds beitragen könnten.

Um jegliche Zweifel zu vermeiden, umfassen diese Güter und Dienstleistungen keinerlei Güter und Dienstleistungen für Reisen, Hotelunterkunft, Unterhaltung oder allgemeine Verwaltung, Büroausstattung bzw. -räumlichkeiten, Beitragsgebühren, Angestelltegehälter oder direkte geldliche Zahlungen.

Transaktionskosten sind Kosten, die bei dem Erwerb, der Ausgabe oder der Veräußerung von übertragbaren Wertpapie-

ren, Geldmarktinstrumenten, Derivaten oder anderen geeigneten Anlagen anfallen. Hierzu können die Geld-Brief-Spanne, Gebühren und Provisionen, die an Vermittler, Berater, Broker und Händler gezahlt werden, sowie transaktionsbezogene Steuern und andere Marktgebühren gehören. Hierzu gehören keine Zu- oder Abschreibungen auf Schulden, Finanzierungskosten oder interne Verwaltungs- oder Bestandskosten. Transaktionskosten sind in den Anlagekosten im Verzeichnis der Anlagewerte sowie unter „Realisierte Gewinne und (Verluste) aus Anlagen, Devisenterminkontrakten, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ und unter „Änderung der unrealisierten Gewinne und (Verluste) aus Anlagen“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens enthalten. Die Transaktionskosten werden in der Gesamtausgabenquote und/oder der Berechnung der Aufwandserstattung unberücksichtigt gelassen.

In der folgenden Tabelle sind die Transaktionskosten, die für die einzelnen Portefeuilles im Berichtszeitraum zum 28. Februar 2023 angefallen sind, aufgeführt:

AB FCPI-	Transaktionskosten
Dynamic Diversified Portfolio	\$ 7,562
Global Equity Blend Portfolio	\$ 28,796
Global Value Portfolio	\$ 236,753
Emerging Markets Growth Portfolio	\$ 597,993
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	\$ 1,039,889
Japan Strategic Value Portfolio	¥ 2,042,986
China Low Volatility Equity Portfolio	\$ 182,451
Short Duration Bond Portfolio	\$ 13,023
Global High Yield Portfolio	\$ 160,703
American Income Portfolio	\$ 324,711
European Income Portfolio	€ 20,049
Emerging Markets Debt Portfolio	\$ 4,881
Mortgage Income Portfolio	\$ 1,812

ANMERKUNG G: Devisentermingeschäfte

Ein Devisentermingeschäft ist eine Verpflichtung zu einem späteren Kauf oder Verkauf einer Fremdwährung zu einem vereinbarten Terminsatz. Der Gewinn bzw. Verlust, der sich aus dem Unterschied zwischen dem ursprünglichen Vertrag und der Glattstellung dieses Vertrags ergibt, wird in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Realisierte Gewinne und Verluste aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ verbucht.

Wertschwankungen offener Devisentermingeschäfte werden zu Finanzberichterstattungszwecken unter „Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung) aus Devisentermingeschäften“ in der Zusammensetzung des Fondsvermögens berücksichtigt.

Eine oder mehrere der Anteilklassen eines Portefeuilles, die in einer bestimmten Währung angeboten werden (jeweils eine „angebotene Währung“), können gegen diese angebotene Währung abgesichert sein. Jede solche Anteilklasse stellt eine „währungsabgesicherte Anteilklasse“ dar. Währungsabgesicherte Anteilklassen zielen darauf ab, den Anlegern eine Rendite zu bieten, die stärker mit der Rendite in der Basiswährung des Portefeuilles korreliert, indem die Auswirkungen der Wechselkursschwankungen zwischen der Basiswährung des

Portefeuilles und der jeweiligen angebotenen Währung reduziert werden, wobei praktische Erwägungen wie Transaktionskosten berücksichtigt werden.

Die eingesetzte Absicherungsstrategie soll das Währungsrisiko zwischen der Basiswährung des Portefeuilles und der jeweils angebotenen Währung zwar reduzieren, aber nicht eliminieren.

Die hiermit verbundenen Risiken sind die potenzielle Unfähigkeit des Kontrahenten, seinen vertraglichen Verpflichtungen nachzukommen, und unerwartete Wertentwicklungen einer Fremdwährung im Vergleich zur abgesicherten Währung.

Da die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilklassen eines Portefeuilles nicht abgegrenzt werden, besteht das unwahrscheinliche Risiko, dass die Währungsabsicherungsgeschäfte einer währungsabgesicherten Anteilklasse unter bestimmten Umständen zu Verbindlichkeiten führen könnten, die sich auf den Nettoinventarwert der anderen Anteilklassen desselben Portefeuilles auswirken könnten. In diesem Fall können die Vermögenswerte der anderen Anteilklassen des Portefeuilles dazu benutzt werden, die Verbindlichkeiten zu decken, die einer solchen währungsabgesicherten Anteilklasse entstanden sind.

Die Wertpapiere im Fonds werden als Sicherheit für Devisentermingeschäfte verwendet.

ANMERKUNG H: Pensionsgeschäfte

Pensionsgeschäfte werden mit Schuldverschreibungen der Vereinigten Staaten, ihrer Behörden oder Vertretungen derselben abgesichert. Die Depotbank hält die Wertpapiere, die einem Pensionsgeschäft zugrunde liegen, stets in einem Wert, der zumindest dem Rückkaufpreis zuzüglich der angefallenen Zinsen entspricht.

Zum 28. Februar 2023 gab es keine Pensionsgeschäfte.

Während des Berichtszeitraums zum 28. Februar 2023 wurden keine Zinserträge aus Pensionsgeschäften verzeichnet.

ANMERKUNG I: Umgekehrte Pensionsgeschäfte

Umgekehrte Pensionsgeschäfte unterscheiden sich von Pensionsgeschäften insofern, dass Wertpapiere nicht vorbehaltlich des Rückkaufs durch den Verkäufer in bar erworben werden, sondern der Fonds Vermögenswerte des Portefeuilles verkauft und gleichzeitig eine Vereinbarung abschließt, dieselben Vermögenswerte zu einem späteren Zeitpunkt zu einem festgelegten Preis, der etwas höher ist als der Verkaufspreis, zurückzukaufen. Während der Laufzeit eines umgekehrten Pensionsgeschäfts erhält der Fonds weiterhin Kapital- und Zinszahlungen auf diese Wertpapiere. Im Allgemeinen kann der Fonds mithilfe eines umgekehrten Pensionsgeschäfts das Geld, das in die relevanten Portefeuille-Wertpapiere investiert wurde, während der Laufzeit des Pensionsgeschäfts vollständig oder größtenteils

zurückherlangen und gleichzeitig die Zinserträge, die mit diesen Portefeuille-Wertpapieren verbunden sind, behalten.

Solche Transaktionen sind nur von Vorteil, wenn die „Zinskosten“ des Fonds bei einem umgekehrten Pensionsgeschäft, d. h. die Differenz zwischen dem Verkaufs- und Rückkaufpreis der Wertpapiere, geringer sind als die Kosten, die ansonsten damit verbunden wären, die Geldsumme zu erhalten, die in die Portefeuille-Wertpapiere investiert ist.

Zum 28. Februar 2023 bestanden keine umgekehrten Pensionsgeschäfte.

Während des Berichtszeitraums zum 28. Februar 2023 wurden keine Zinserträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften verzeichnet.

ANMERKUNG J: Finanzterminkontrakte

Der Fonds kann Finanzterminkontrakte kaufen oder verkaufen. Der Fonds trägt die Verantwortung für die Marktrisiken, die sich aus den Wertänderungen dieser Finanzinstrumente ergeben. Die Terminkontrakte, deren Kontrahenten kein Kreditrisiko darstellen, werden vom Fonds an geregelten Börsen abgeschlossen.

Zu dem Zeitpunkt, an dem der Fonds einen Finanzterminkontrakt abschließt, hinterlegt und hält er beim Broker die von der Börse, an der der Kontrakt abgeschlossen wird, erforderte Sicherheitsleistung in Form einer Einschusszahlung.

Der Fonds erklärt sich nach dem Kontrakt einverstanden, einen Bargeldbetrag vom Broker in Empfang zu nehmen oder diesem zu bezahlen, der den täglichen Wertschwankungen des Kontrakts entspricht. Dieser Zahlungsempfang bzw. diese Zahlung wird als Einschusszahlung bezeichnet und vom Fonds als unrealisierter Gewinn bzw. Verlust verbucht. Nach der Glattstellung des Kontrakts weist der Fonds in Höhe des Unterschieds zwischen dem Wert des Kontrakts bei Abschluss und bei der Glattstellung einen realisierten Gewinn bzw. Verlust aus.

ANMERKUNG K: Swap-Geschäfte

Ein Swap ist eine Vereinbarung, die zwei Parteien dazu verpflichtet, in festgelegten Abständen eine Reihe von Cashflows auszutauschen, welche auf Veränderungen bei bestimmten Kursen oder Sätzen für eine bestimmte Anzahl eines zugrunde liegenden Vermögenswertes oder einem auf andere Weise festgelegten Nominalbetrag basieren bzw. unter Bezugnahme hierauf berechnet werden. Realisierte Gewinne und (Verluste) sowie Veränderungen der unrealisierten Gewinne und (Verluste) aus Swaps sind in der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens jeweils unter „Realisierte Gewinne und (Verluste) aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ und „Veränderung der unrealisierten Gewinne und (Verluste) aus Swaps“ enthalten.

Zentral abgerechnete Credit-Default-Swaps

Bei einer zentral abgerechneten Credit-Default-Swap-Vereinbarung ist der Käufer verpflichtet, dem Verkäufer über die Laufzeit der Vereinbarung hinweg regelmäßige Zahlungen zu leisten, wofür er im Gegenzug eine bedingte Zahlung erhält, falls ein Kreditereignis in Bezug auf eine zugrunde liegende Referenz-Obligation eintritt.

Zentral abgerechnete Zinsswaps

Ein zentral abgerechneter Zinsswap ist eine gegenseitige Vereinbarung, bei der beide Parteien dem Austausch einer Reihe von fest- oder variabel verzinslichen Zahlungen zustimmen, die auf Basis eines Nominalbetrags berechnet werden.

Total-Return-Swaps

Ein Total-Return-Swap ist eine gegenseitige Vereinbarung, bei der beide Parteien dem Austausch der Gesamtwertentwicklung eines zugrunde liegenden Vermögenswertes gegen eine Reihe von Zinszahlungen zustimmen, die auf Basis eines Nominalbetrags berechnet werden.

Credit-Default-Swaps

Bei einer Credit-Default-Swap-Vereinbarung ist der Käufer verpflichtet, dem Verkäufer über die Laufzeit der Vereinbarung hinweg regelmäßige Zahlungen zu leisten, wofür er im Gegenzug eine bedingte Zahlung erhält, falls ein Kreditereignis in Bezug auf eine zugrunde liegende Referenz-Obligation eintritt.

Zinsswaps

Ein Zinsswap ist eine bilaterale Vereinbarung, bei der beide Parteien dem Austausch einer Reihe von fest- oder variabel verzinslichen Zahlungen zustimmen, die auf Basis eines Nominalbetrags berechnet werden.

Inflationsswap

Ein Inflationsswap ist eine bilaterale Vereinbarung, bei der beide Parteien dem Austausch von festverzinslichen Zahlun-

gen gegen variabel verzinsliche, Inflationsindex-gebundene Zahlungen zustimmen, die auf Basis eines Nominalbetrags berechnet werden.

ANMERKUNG L: Optionsgeschäfte

Der Fonds kann Kauf- und Verkaufsoptionen auf Wertpapiere kaufen und verkaufen. Das mit dem Kauf einer Option verbundene Risiko besteht darin, dass der Fonds eine Prämie bezahlt, unabhängig davon, ob die Option ausgeübt wird oder nicht. Außerdem besteht das Risiko, dass der Fonds die Prämie verliert und sich der Marktwert verändert, sollte der Kontrahent seinen vertraglichen Verpflichtungen nicht nachkommen. Gekaufte Kauf- und Verkaufsoptionen werden auf dieselbe Art ausgewiesen wie die Wertpapiere eines Portefeuilles. Die Kosten für die durch Ausübung einer Kaufoption gekauften Wertpapiere erhöhen sich um die gezahlten Prämien. Die Erlöse aus den durch Ausübung einer Verkaufsoption verkauften Wertpapieren verringern sich um die gezahlten Prämien.

Wenn der Fonds eine Option verkauft, wird die vom Fonds erhaltene Prämie als Verbindlichkeit verbucht und anschließend an den aktuellen Marktwert der verkauften Option angepasst.

Für verkaufte Optionen erhaltene Prämien, die auslaufen, ohne ausgeübt zu werden, werden vom Fonds am Verfallstermin als realisierter Gewinn aus verkauften Optionen verbucht. Die Differenz zwischen der erhaltenen Prämie und dem gezahlten Betrag bei Ausführung einer Glattstellungstransaktion, einschließlich Händlerprovisionen, wird ebenfalls als realisierter Gewinn behandelt, bzw. als realisierter Verlust, wenn die erhaltene Prämie geringer ist als der bezahlte Betrag für die Glattstellungstransaktion.

Wird eine Kaufoption ausgeübt, wird die Prämie zum Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers oder der Währung addiert, um zu ermitteln, ob der Fonds einen Gewinn oder Verlust realisiert hat. Wird eine Verkaufsoption ausgeübt, wird die erhaltene Prämie von den Kosten des vom Fonds gekauften Wertpapiers oder der gekauften Währung abgezogen. Beim Verkauf einer Option trägt der Fonds das Marktrisiko, dass sich der Kurs des Wertpapiers oder der Währung, das bzw. die der verkauften Option zugrunde liegt, ungünstig verändert. Die Ausübung einer vom Fonds verkauften Option könnte dazu führen, dass der Fonds ein Wertpapier oder eine Währung zu einem Preis kauft bzw. verkauft, der vom aktuellen Marktwert abweicht.

Der Fonds kann auch in Optionen auf Swap-Vereinbarungen, sogenannte Swaptions, investieren. Eine Swaption ist eine Option, die dem Käufer das Recht gibt, jedoch nicht die Verpflichtung, zu einem Zeitpunkt in der Zukunft im Austausch gegen Zahlung einer marktüblichen Prämie ein Swap-Geschäft abzuschließen. Eine Receiver Swaption gibt dem Erwerber das Recht auf Empfang der Gesamtrendite eines bestimmten Vermögenswertes, eines Referenzsatzes oder eines Index. Eine Payer Swaption gibt dem Erwerber das Recht auf Zahlung der Gesamtrendite eines bestimmten Vermögenswertes, eines Referenzsatzes oder eines Index. Swaptions umfassen ferner Optionen, die es ermöglichen, dass ein bestehendes Swap-Geschäft durch einen der Kontrahenten beendet oder verlängert wird.

ANMERKUNG M: Sicherheiten

In der folgenden Tabelle sind die Barsicherheiten aufgeführt, die zum 28. Februar 2023 für bestimmte derivative Finanzinstrumente vom Broker gehalten wurden bzw. diesem zu entrichten waren:

AB FCPI –	Vom Broker gehaltene Barmittel	Dem Broker zu entrichtende Barmittel
Dynamic Diversified Portfolio . . .		
Citibank	\$ 26,432	–
Morgan Stanley	\$ 424,677	103,738
Global Equity Blend Portfolio . . .		
Bank of America	\$ 487	–
Citibank	\$ 31,651	42,025
Morgan Stanley	\$ 5,010	2,712
Global Value Portfolio		
Citibank	\$ –	577,975
Morgan Stanley	\$ –	37,288
Short Duration Bond Portfolio . . .		
Citibank	\$ 1,131,013	60,961
Morgan Stanley	\$ 3,459,058	1,192,724
Global High Yield Portfolio		
Bank of America	\$ 700,000	1,100,000
Citibank	\$ 11,450,790	–
Goldman Sachs	\$ 250,000	–
JPMorgan Chase	\$ 31,419,000	–
Morgan Stanley	\$ 48,284,006	92,706,396

AB FCPI –	Vom Broker gehaltene Barmittel	Dem Broker zu entrichtende Barmittel
American Income Portfolio		
Citibank	\$ 48,750,000	34,851,891
Credit Suisse	\$ 2,960,000	–
Deutsche Bank	\$ 276,060	10,581,136
Goldman Sachs	\$ 3,310,000	–
JPMorgan Chase	\$ 44,226,000	–
Morgan Stanley	\$ 75,281,776	–
European Income Portfolio		
Citibank	€ 4,285,288	–
Goldman Sachs	€ 23,100,230	707,567
Emerging Markets Debt Portfolio . .		
JPMorgan Chase	\$ –	260,000
Goldman Sachs	\$ 97,958	–
Morgan Stanley	\$ 5,638,414	60,000
Mortgage Income Portfolio		
Citibank	\$ 800,706	–
Credit Suisse	\$ 1,031,400	–
Goldman Sachs	\$ 467,000	–
JPMorgan Chase	\$ 738,000	–
Morgan Stanley	\$ 2,467,090	3,056,787

Barsicherheiten, die von Brokern in Bezug auf Derivate gehalten bzw. diesen geschuldet werden, sind in der Zusammensetzung des Fondsvermögens unter „Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel“ und „An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar“ ausgewiesen.

In Bezug auf die am 28. Februar 2023 von den einzelnen Portefeuilles gehaltenen Derivate sind in der folgenden Tabelle aus Wertpapieren bestehende Sicherheiten aufgeführt:

AB FCPI –	Marktwert der dem Broker bereitgestellten Sicherheiten	Marktwert der vom Broker erhaltenen Sicherheiten	AB FCPI –	Marktwert der dem Broker bereitgestellten Sicherheiten	Marktwert der vom Broker erhaltenen Sicherheiten
Short Duration Bond Portfolio . . .			U.S. Treasury Notes, 1.88%, 02/15/2032	\$ 4,232,813	–
UBS AG			U.S. Treasury Notes, 3.13%, 08/31/2029	\$ 31,328,525	–
U.S. Treasury Notes, 4.38%, 10/31/2024	\$ 277,034	–	U.S. Treasury Notes, 3.88%, 11/30/2027	\$ 1,676,480	–
Global High Yield Portfolio			American Income Portfolio..		
Citibank			Barclays		
U.S. Treasury Bonds, 6.75%, 08/15/2026	\$ 35,742,679	–	U.S. Treasury Bonds, 7.63%, 02/15/2025	\$ 4,473,947	–
U.S. Treasury Notes, 3.88%, 11/30/2027	\$ 3,351,678	–	Citibank		
Credit Suisse			U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 08/15/2029	\$ 233,522,497	–
U.S. Treasury Notes, 3.13%, 08/31/2029	\$ 16,638,346	–	Credit Suisse		
Deutsche Bank			U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 08/15/2029	\$ 7,950,784	–
U.S. Treasury Notes, 3.88%, 11/30/2027	\$ 3,029,725	–	Goldman Sachs		
Goldman Sachs			U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 08/15/2029	\$ 24,722,817	–
U.S. Treasury Notes, 3.13%, 08/31/2029	\$ 43,295,367	–	Morgan Stanley		
Morgan Stanley			U.S. Treasury Bonds, 7.63%, 02/15/2025	\$ 15,227,386	–
U.S. Treasury Bonds, 6.75%, 08/15/2026	\$ 147,205,936	–			

ANMERKUNG N: Verleih von Portefeuille-Wertpapieren

Ein Portefeuille kann seine Wertpapiere besichert verleihen. Das Risiko, das mit dem Verleih von Wertpapieren verbunden ist, besteht genau wie bei anderen Kreditgewährungen in dem möglichen Verlust des Anrechts auf die Sicherheiten, falls der Entleiher in Konkurs geht. Darüber hinaus wird ein Portefeuille dem Risiko ausgesetzt sein, dass der Erlös aus dem Verkauf jeglicher Sicherheiten, der nach dem Zahlungsverzug des Entleihers realisiert wird, nicht ausreicht, um die verliehenen Wertpapiere zu ersetzen.

Um festzulegen, ob Wertpapiere an einen bestimmten Entleiher verliehen werden sollten oder nicht, wird der Anlageverwalter alle relevanten Fakten und Umstände berücksichtigen, wozu u. a. die Kreditwürdigkeit des Entleihers zählt.

Während die Wertpapiere verliehen sind, zahlt der Entleiher dem jeweiligen Portefeuille möglicherweise alle aus diesen Wertpapieren generierten Erträge. Das Portefeuille kann alle Barsicherheiten in Geldmarktinstrumente investieren und dadurch zusätzliche Erträge erwirtschaften oder aber einen vereinbarten Betrag an Erträgen von einem Entleiher erhalten, der entsprechende Sicherheiten geliefert hat.

Das Portefeuille hat u. U. das Recht, das eingetragene Eigentum an den verliehenen Wertpapieren oder äquivalenten Wertpapieren zurückzuerlangen, um Eigentumsrechte auszuüben, wie beispielsweise Stimmrechte, Zeichnungsrechte und Rechte auf Dividenden, Zinsen oder Ausschüttungen. Ein Portefeuille kann angemessene Konsortialführer-, Verwaltungs- und sonstige Gebühren im Zusammenhang mit einer Ausleiher zahlen.

Für besicherte Wertpapierleihen erhält ein Portefeuille Brutto-Gebühreneinnahmen, von denen 20% an die Wertpapierleihstelle für die Bereitstellung von Wertpapierleihdiensten entrichtet werden.

Für den Berichtszeitraum zum 28. Februar 2023 erwirtschafteten die Portefeuilles Nettogebühreneinnahmen, die in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Erträge aus der Wertpapierleihe, netto“ ausgewiesen sind.

Für den Berichtszeitraum zum 28. Februar 2023 verdiente Brown Brothers Harriman & Co. (in seiner Funktion als Wertpapierleihstelle) ein Honorar von \$54,741 für die Bereitstellung von Wertpapierleihdiensten. Dieses Honorar ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Erträge aus der Wertpapierleihe, netto“ ausgewiesen. Die zum 28. Februar 2023 verliehenen Wertpapiere und die entsprechenden ausstehenden Sicherheiten haben folgenden Wert. Die Sicherheiten beziehen sich auf die in den Portefeuilles gehaltenen Wertpapiere.

AB FCPI –	Wert	Marktwert der Sicherheiten
Global Equity Blend Portfolio		
Merrill Lynch	\$ 720,842	762,335
UBS AG	\$ 685,733	720,071
Citigroup Global Markets Limited	\$ 466,456	489,820

AB FCPI –	Wert	Marktwert der Sicherheiten
Global Value Portfolio		
Merrill Lynch	\$ 9,914,185	10,484,869
Citigroup Global Markets Limited	\$ 6,415,451	6,736,797
UBS AG	\$ 333,705	350,414
Asia Ex-Japan Equity Portfolio		
Societe Generale	\$ 4,709,504	5,312,976
Barclays	\$ 270,948	306,601

AB FCPI –	Wert	Marktwert der Sicherheiten
Japan Strategic Value Portfolio		
Merrill Lynch	¥ 973,127,429	1,029,142,967
China Low Volatility Equity Portfolio		
Merrill Lynch	\$ 1,774,537	1,876,684

ANMERKUNG O: Bankkredite

Vorbehaltlich gewisser Einschränkungen kann der Fonds über einen von der Depotbank verliehenen Überziehungskredit (die „Fazilität“) verfügen, um gegebenenfalls eine ungewöhnlich hohe Zahl von Rücknahmen kurzfristig oder vorübergehend zu finanzieren.

Die Portefeuilles des Fonds können nur Kredite in Höhe von 10% ihres jeweiligen Nettovermögens aufnehmen. Auf die über die Fazilität erhaltenen Kredite sind Zinsen in der vereinbarten Höhe zu entrichten; ferner werden sie mit den zugrunde liegenden Vermögenswerten des jeweiligen Portefeuilles besichert.

ANMERKUNG P: Gemeinsame Verwaltung von Vermögenswerten

Zum Zwecke der effizienten Verwaltung kann die Verwaltungsgesellschaft Vermögenswerte bestimmter Portefeuilles innerhalb oder außerhalb des Fonds gemeinsam verwalten, wenn dies gemäß der Anlagepolitik des jeweiligen Portefeuilles gestattet ist. In diesem Fall werden die Vermögenswerte verschiedener Portefeuilles gemeinsam verwaltet. Auf gemeinsam verwaltete Vermögenswerte wird als „Pool“ Bezug genommen. Diese Pool-Vereinbarungen dienen dazu, die operativen und anderen Aufwendungen zu reduzieren; die gesetzlichen Rechte und Pflichten der Anteilinhaber ändern sich dadurch nicht. Die Pools sind keine separaten juristischen Personen; Anleger können nicht direkt auf diese Pools zugreifen. Jedes Portefeuille behält das Anrecht auf seine eigenen spezifischen Vermögenswerte.

fasst werden, wird der Anteil des Pools an Vermögenswerten, der jedem einzelnen beteiligten Portefeuille zuzurechnen ist, mit dem Verweis auf die ursprüngliche Beteiligung des Portefeuilles an diesem Pool verzeichnet, der sich im Falle weiterer Zuweisungen bzw. im Falle von Abzügen ändern kann. Der Anspruch jedes einzelnen beteiligten Portefeuilles auf die gemeinsam verwalteten Vermögenswerte gilt für alle Arten von Anlagen des Pools.

Wenn die Vermögenswerte verschiedener Portefeuilles zum Zwecke der gemeinsamen Verwaltung zu Pools zusammenge-

Zusätzliche Anlagen, die für die gemeinsam verwalteten Portefeuilles getätigt werden, werden den einzelnen Portefeuilles proportional zu ihren Ansprüchen zugewiesen. Vermögenswerte, die abgestoßen werden, werden auf dieselbe Weise vom Anspruch jedes einzelnen beteiligten Portefeuilles abgezogen.

Zum 28. Februar 2023 verwaltet der Fonds die Vermögenswerte bestimmter Portefeuilles innerhalb des Fonds unter Verwendung der folgenden Pools gemeinsam:

Pool an Vermögenswerten

ACM Bernstein-Global Growth Pool
 ACM Global Investments-Global Value Pool

Beteiligte Portefeuilles

Global Equity Blend Portfolio
 Global Equity Blend Portfolio
 Global Value Portfolio

ANMERKUNG Q: Nachfolgende Ereignisse

Der Verwaltungsrat hat beschlossen, die Restrukturierung des AB FCP I – Global Value Portfolio in das SICAV I – Global Value Portfolio mit Wirkung zum 31. März 2023 zu genehmigen.

TABELLE 1

GEBÜHRENSTRUKTUR

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Dynamic Diversified Portfolio**				
Klasse				
A	1.70%	0.10%	N/A	1.95%
A EUR	1.70%	0.10%	N/A	1.95%
A EUR H	1.70%	0.10%	N/A	1.95%
AX	1.40%	0.10%	N/A	1.90%
AX EUR	1.40%	0.10%	N/A	1.90%
AX SGD	1.40%	0.10%	N/A	1.90%
BX	1.40%	0.10%	1.00%	2.90%
BX SGD(a)	1.40%	0.10%	1.00%	2.90%
C	1.90%	0.10%	N/A	2.25%
C EUR	1.90%	0.10%	N/A	2.25%
C EUR H	1.90%	0.10%	N/A	2.25%
CX	1.70%	0.10%	N/A	2.20%
I	0.90%	0.10%	N/A	1.25%
I EUR	0.90%	0.10%	N/A	1.25%
I EUR H	0.90%	0.10%	N/A	1.25%
IX	0.70%	0.10%	N/A	1.20%
Global Equity Blend Portfolio				
Klasse				
A	1.60%	0.10%	N/A	2.10%
A EUR	1.60%	0.10%	N/A	2.10%
A EUR H	1.60%	0.10%	N/A	2.10%
A SGD	1.60%	0.10%	N/A	2.10%
B	1.60%	0.10%	1.00%	3.10%
B SGD	1.60%	0.10%	1.00%	3.10%
C	2.05%	0.10%	N/A	2.55%
C EUR	2.05%	0.10%	N/A	2.45%
I	0.80%	0.10%	N/A	1.30%
I EUR	0.80%	0.10%	N/A	1.30%
S HKD	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S1	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.80%
S1 EUR	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.80%
S1 GBP	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.80%
S1 SGD	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.80%
Global Value Portfolio				
Klasse				
A	1.50%	0.10%	N/A	1.80%
A EUR	1.50%	0.10%	N/A	1.80%
A SGD	1.50%	0.10%	N/A	1.80%
A SGD H	1.50%	0.10%	N/A	1.80%
AD	1.50%	0.10%	N/A	1.80%
AD AUD H	1.50%	0.10%	N/A	1.78%
AD CAD H	1.50%	0.10%	N/A	1.80%
AD EUR H	1.50%	0.10%	N/A	1.80%
AD GBP H	1.50%	0.10%	N/A	1.80%
AD HKD	1.50%	0.10%	N/A	1.80%
AD ZAR H	1.50%	0.10%	N/A	1.80%
B	1.50%	0.10%	1.00%	2.80%
C	1.95%	0.10%	N/A	2.25%
C EUR	1.95%	0.10%	N/A	2.25%
I	0.70%	0.10%	N/A	1.01%
I EUR	0.70%	0.10%	N/A	1.00%
I GBP	0.70%	0.10%	N/A	0.96%

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Global Value Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
I SGD	0.70%	0.10%	N/A	1.00%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.11%
S GBP	N/A	0.01%(8)	N/A	0.11%
S GBP H	N/A	0.01%(8)	N/A	0.11%
S1	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.82%
S1 AUD H	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.82%
S1 EUR	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.79%
S1 GBP	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.82%
SD	N/A	0.01%(8)	N/A	0.11%

Emerging Markets Growth Portfolio

Klasse				
A	1.70%	0.10%	N/A	2.02%
A AUD H	1.70%	0.10%	N/A	2.02%
A EUR	1.70%	0.10%	N/A	2.02%
A HKD	1.70%	0.10%	N/A	2.02%
A PLN H	1.70%	0.10%	N/A	2.01%
A SGD	1.70%	0.10%	N/A	2.01%
A SGD H	1.70%	0.10%	N/A	2.02%
AD	1.70%	0.10%	N/A	2.04%
B	1.70%	0.10%	1.00%	3.02%
C	2.15%	0.10%	N/A	2.47%
C EUR	2.15%	0.10%	N/A	2.47%
ED	1.70%	0.10%	1.00%	3.01%
I	0.90%	0.10%	N/A	1.22%
I AUD H	0.90%	0.10%	N/A	1.23%
I EUR	0.90%	0.10%	N/A	1.21%
N	2.15%	0.10%	N/A	2.46%
S1	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.04%
S1 EUR	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.98%
S1 GBP	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.97%

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Klasse				
A	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
A AUD H	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
A EUR	1.70%	0.05%	N/A	2.02%
A HKD	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
A SGD H	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD AUD H	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD CAD H	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD EUR	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD EUR H	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD GBP H	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD HKD	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD NZD H	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD RMB H	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD ZAR H	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AY JPY	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
BD(a)	1.70%	0.05%	1.00%	3.03%
BD AUD H(b)	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
BD HKD(a)	1.70%	0.05%	1.00%	3.03%
BY JPY	1.45%	0.05%	0.72%	2.52%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Asia Ex-Japan Equity Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
C	2.15%	0.05%	N/A	2.50%
C EUR	2.15%	0.05%	N/A	2.50%
ED	1.70%	0.05%	1.00%	3.05%
ED AUD H	1.70%	0.05%	1.00%	3.05%
I	0.90%	0.05%	N/A	1.25%
I AUD H	0.90%	0.05%	N/A	1.25%
I EUR	0.90%	0.05%	N/A	1.25%
I GBP	0.90%	0.05%	N/A	1.25%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.22%
S HKD	N/A	0.01%(8)	N/A	0.22%
S1	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.11%
S1 EUR	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.08%
SD	N/A	0.01%(8)	N/A	0.22%
Japan Strategic Value Portfolio				
Klasse				
A	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A CZK H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A EUR	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A EUR H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A PLN	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A SGD	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A SGD H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A USD	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A USD H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AD	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AD AUD H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AD NZD H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AD USD H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AD ZAR H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
C	1.95%	0.05%	N/A	2.60%
C EUR	1.95%	0.05%	N/A	2.60%
C EUR H	1.95%	0.05%	N/A	2.60%
C USD	1.95%	0.05%	N/A	2.60%
I	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
I EUR	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
I EUR H	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
I SGD	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
I USD	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
I USD H	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
S EUR H	N/A	0.01%(8)	N/A	0.15%
S1 EUR	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.80%
S1 USD	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.80%
SD	N/A	0.01%(8)	N/A	0.15%
China Low Volatility Equity Portfolio				
Klasse				
A	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A EUR	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A HKD	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A PLN H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD AUD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD CAD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
China Low Volatility Equity Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
AD EUR H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD GBP H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD HKD	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD NZD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD SGD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD ZAR H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
B	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
B EUR	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
BD NZD H(b)	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
C	2.15%	0.05%	N/A	2.44%
C EUR	2.15%	0.05%	N/A	2.44%
I	0.90%	0.05%	N/A	1.19%
I EUR	0.90%	0.05%	N/A	1.19%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.16%
S1	0.75%	0.01%(8)	N/A	0.91%
S1 EUR	0.75%	0.01%(8)	N/A	0.91%

Short Duration Bond Portfolio

Klasse				
A	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
A EUR	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
A2	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
A2 EUR	0.85%	0.10%	N/A	1.19%
A2 EUR H	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
A2 HKD	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
AA	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
AA AUD H	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
AA CAD H	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
AA GBP H	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
AA HKD	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
AA SGD H	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
AJ	0.65%	0.10%	N/A	1.00%
AT	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
AT AUD H	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
AT CAD H	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
AT EUR	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
AT EUR H	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
AT GBP H	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
AT HKD	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
AT NZD H	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
AT SGD H	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
AX	0.65%	0.10%	N/A	1.00%
B	0.85%	0.10%	1.00%	2.20%
C	1.25%	0.10%	N/A	1.60%
C2	1.25%	0.10%	N/A	1.60%
C2 EUR H	1.25%	0.10%	N/A	1.60%
I	0.325%	0.10%	N/A	0.58%
I EUR	0.325%	0.10%	N/A	0.58%
I2	0.325%	0.10%	N/A	0.58%
I2 EUR	0.325%	0.10%	N/A	0.58%
I2 EUR H	0.325%	0.10%	N/A	0.58%
IT	0.325%	0.10%	N/A	0.58%
N2	1.35%	0.10%	N/A	1.70%
NT	1.35%	0.10%	N/A	1.70%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Short Duration Bond Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
S.....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S1 2.....	0.25%	0.01%(8)	N/A	0.35%
S1 2 EUR.....	0.25%	0.01%(8)	N/A	0.35%
SA.....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
.....				
Global High Yield Portfolio**				
Klasse				
A.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
A EUR.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
A2.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
A2 CHF H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
A2 EUR.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
A2 EUR H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
A2 HKD.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
A2 PLN H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
A2 SGD.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
A2 SGD H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AA.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AA AUD H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AA CAD H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AA EUR H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AA GBP H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AA HKD.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AA NZD H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AA RMB H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AA SGD H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AA ZAR H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AK.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AK EUR.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AK EUR H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AR EUR H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.63%
AT.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AT AUD H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AT CAD H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AT EUR.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AT EUR H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AT GBP H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AT HKD.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AT NZD H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AT RMB H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AT SGD.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
AT SGD H.....	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
B.....	1.41%(1)	0.10%	1.00%	2.64%
B2.....	1.41%(1)	0.10%	1.00%	2.63%
BA AUD H(a).....	1.36%(1)	0.10%	1.00%	2.56%
BT.....	1.41%(1)	0.10%	1.00%	2.64%
BT AUD H.....	1.41%(1)	0.10%	1.00%	2.59%
BT HKD(c).....	1.41%(1)	0.10%	1.00%	2.58%
BT NZD H(c).....	1.42%(1)	0.10%	1.00%	2.34%
C.....	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.14%
C EUR.....	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.14%
C2.....	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.13%
C2 EUR.....	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.14%
C2 EUR H.....	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.14%

Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)**

Klasse	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
CK	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.13%
CK EUR H	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.11%
CT	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.14%
EA	1.41%(1)	0.10%	0.50%	2.14%
EA AUD H	1.41%(1)	0.10%	0.50%	2.14%
EA ZAR H	1.41%(1)	0.10%	0.50%	2.14%
I	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.14%
I EUR	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.14%
I2	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.14%
I2 AUD H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.14%
I2 CHF H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.15%
I2 EUR	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.14%
I2 EUR H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.14%
I2 SGD	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.14%
I2 SGD H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.14%
IA AUD H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.14%
IQD	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.14%
IQD EUR(d)	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.13%
IT	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.14%
IT AUD H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.14%
IT CAD H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.14%
IT EUR H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.14%
IT GBP H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.13%
IT HKD	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.14%
IT RMB H	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.14%
J	1.41%(1)	0.10%	1.00%	2.64%
N2	1.96%(4)	0.10%	N/A	2.19%
NT	1.96%(4)	0.10%	N/A	2.19%
S1	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.94%
S1 EUR	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.93%
S1D	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.94%
S1D2	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.94%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.04%
SHK	N/A	0.01%(8)	N/A	0.04%
SK	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.69%
W	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
W EUR	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.95%
W2	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
W2 CHF H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
W2 EUR H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
WT	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
WT AUD H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
WT CAD H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
WT EUR H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
WT GBP H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
WT RMB H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%

American Income Portfolio**

Klasse	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
A	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A EUR	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A2	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A2 CHF H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A2 DUR PH	1.10%	0.10%	N/A	1.32%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
American Income Portfolio** (Fortsetzung)				
Klasse				
A2 EUR	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A2 EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A2 HKD	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A2 PLN H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A2 SGD	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
A2 SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA AUD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA CAD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA DUR PH	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA GBP H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA HKD	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA NZD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA RMB H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AA ZAR H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AK	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AK EUR	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AK EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AR EUR	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AR EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT AUD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT CAD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT DUR PH	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT EUR	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT GBP H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT HKD	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT NZD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT RMB H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT SGD	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
AT SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.32%
B	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
B2	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
B2 HKD(a)	1.10%	0.10%	0.70%	2.01%
BA(e)	1.10%	0.10%	0.70%	1.99%
BA AUD H(b)	1.10%	0.10%	0.70%	1.98%
BT	1.10%	0.10%	0.70%	2.01%
BT AUD H(b)	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
BT CAD H(b)	1.10%	0.10%	0.70%	1.99%
BT GBP H(b)	1.10%	0.10%	0.70%	1.97%
BT HKD(b)	1.10%	0.10%	0.70%	1.98%
BT NZD H(e)	1.10%	0.10%	0.70%	1.99%
C	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
C EUR	1.55%	0.10%	N/A	1.76%
C2	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
C2 DUR PH	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
C2 EUR	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
C2 EUR H	1.55%	0.10%	N/A	1.78%
CT	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
EA	1.10%	0.10%	0.50%	1.82%
EA AUD H	1.10%	0.10%	0.50%	1.82%

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
American Income Portfolio** (Fortsetzung)				
Klasse				
EA ZAR H	1.10%	0.10%	0.50%	1.82%
I	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I EUR	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
I2	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I2 AUD H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I2 CHF H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I2 DUR PH	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I2 EUR	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I2 EUR H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I2 HKD	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
I2 SGD	0.55%	0.10%	N/A	0.74%
I2 SGD H	0.55%	0.10%	N/A	0.78%
IA	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IA AUD H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
IT AUD H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT CAD H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT EUR H	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
IT GBP H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT HKD	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
IT JPY	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT JPY H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT NZD H	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
IT RMB H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT SGD	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT SGD H	0.55%	0.10%	N/A	0.78%
J	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
L2	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
LT	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
N2	1.65%	0.10%	N/A	1.87%
NT	1.65%	0.10%	N/A	1.87%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.04%
S1	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.54%
S1 EUR(f)	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.54%
S1D	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.54%
S1D2	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.54%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.04%
SHK	N/A	0.01%(8)	N/A	0.04%
W	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.61%
W2	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.61%
W2 CHF H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
W2 EUR H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.61%
WT	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.61%
WT AUD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
WT EUR H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.61%
WT GBP H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.62%
WT HKD	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.62%
WT SGD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.61%

European Income Portfolio

Klasse				
A	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
A USD	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
A2	1.10%	0.10%	N/A	1.37%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
European Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
A2 CHF H	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
A2 PLN H	1.10%	0.10%	N/A	1.38%
A2 USD	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
A2 USD H	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AA	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AA AUD H	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AA HKD H	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AA RMB H	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AA SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AA USD H	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AK	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AR	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AT	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AT AUD H	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AT SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AT USD	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AT USD H	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
B USD	1.10%	0.10%	0.70%	2.07%
B2	1.10%	0.10%	0.70%	2.05%
B2 USD	1.10%	0.10%	0.70%	2.06%
BA AUD H(b)	1.10%	0.10%	0.70%	2.04%
BA USD H(g)	1.10%	0.10%	0.70%	2.04%
BT(a)	1.10%	0.10%	0.70%	2.03%
BT AUD H(a)	1.10%	0.10%	0.70%	2.03%
BT USD H(a)	1.10%	0.10%	0.70%	2.03%
C	1.55%	0.10%	N/A	1.82%
C USD	1.55%	0.10%	N/A	1.82%
C2	1.55%	0.10%	N/A	1.82%
C2 USD	1.55%	0.10%	N/A	1.82%
C2 USD H	1.55%	0.10%	N/A	1.82%
CK	1.55%	0.10%	N/A	1.82%
CT USD H	1.55%	0.10%	N/A	1.82%
I	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
I USD	0.55%	0.10%	N/A	0.83%
I2	0.55%	0.10%	N/A	0.83%
I2 AUD H	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
I2 CHF H	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
I2 USD	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
I2 USD H	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
IA	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
IA HKD H	0.55%	0.10%	N/A	0.80%
IA SGD H	0.55%	0.10%	N/A	0.80%
IA USD H	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
IT	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
IT SGD H	0.55%	0.10%	N/A	0.80%
IT USD H	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
NT USD H	1.65%	0.10%	N/A	1.92%
S1	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.60%
S1 USD	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.57%
S1 USD H	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.60%
S1D	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.60%
SA USD H	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
SHK	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
W2	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.66%

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
European Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
W2 CHF H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.66%
W2 USD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.65%
WA	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.67%
WA HKD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.65%
WA USD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.66%
WT	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.66%
WT SGD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.65%
WT USD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.65%
Emerging Markets Debt Portfolio**				
Klasse				
A	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A2 CHF H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
A2 EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A2 EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.39%
A2 HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A2 PLN	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A2 PLN H	1.10%	0.05%	N/A	1.39%
A2 SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AA	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AA AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AA CAD H	1.10%	0.05%	N/A	1.39%
AA EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
AA GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AA HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AA NZD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AA RMB H	1.10%	0.05%	N/A	1.38%
AA SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AA ZAR H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AI	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AI AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.39%
AR EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
AT	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT CAD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT NZD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
B2 HKD(c)	1.10%	0.05%	1.00%	2.35%
BT	1.10%	0.05%	1.00%	2.40%
C	1.55%	0.05%	N/A	1.85%
C EUR	1.55%	0.05%	N/A	1.84%
C2	1.55%	0.05%	N/A	1.85%
C2 EUR	1.55%	0.05%	N/A	1.85%
C2 EUR H	1.55%	0.05%	N/A	1.82%
CT	1.55%	0.05%	N/A	1.83%
EA	1.10%	0.05%	0.50%	1.90%
EA AUD H	1.10%	0.05%	0.50%	1.90%
EA ZAR H	1.10%	0.05%	0.50%	1.90%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Emerging Markets Debt Portfolio** (Fortsetzung)				
Klasse				
EI	1.10%	0.05%	0.50%	1.90%
EI AUD H	1.10%	0.05%	0.50%	1.90%
I	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
I2	0.55%	0.05%	N/A	0.84%
I2 AUD H	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
I2 CHF H	0.55%	0.05%	N/A	0.83%
I2 EUR	0.55%	0.05%	N/A	0.86%
I2 EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
IT AUD H	0.55%	0.05%	N/A	0.81%
IT EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
N2	1.65%	0.05%	N/A	1.95%
NT	1.65%	0.05%	N/A	1.95%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.11%
S1 2	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.70%
S1 2 EUR	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.64%
S1 EUR H	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.65%
S1 GBP H	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.66%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.15%
Mortgage Income Portfolio				
Klasse				
A	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
A2 EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
A2 HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
A2 SGD	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
A2X	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.25%
A2X EUR	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.25%
AA	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AA AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AA HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AA RMB H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AA SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AA ZAR H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AR EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AT GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT SGD	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AT SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AX	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.25%
AX EUR	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.25%
BX	1.05%(5)	0.05%	0.45%	1.70%
BX EUR	1.05%(5)	0.05%	0.45%	1.70%
C	1.55%	0.05%	N/A	1.80%
C2	1.55%	0.05%	N/A	1.80%
C2 EUR	1.55%	0.05%	N/A	1.78%
CX	1.50%(6)	0.05%	N/A	1.70%
I	0.55%	0.05%	N/A	0.80%
I EUR	0.55%	0.05%	N/A	0.80%
I2	0.55%	0.05%	N/A	0.80%
I2 EUR	0.55%	0.05%	N/A	0.80%

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Mortgage Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
I2 EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.86%
IT EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.79%
IX	0.50%(7)	0.05%	N/A	0.70%
N2	1.65%	0.05%	N/A	1.90%
NT	1.65%	0.05%	N/A	1.90%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.09%
S1	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.62%
S1 AUD H	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.62%
S1 EUR	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.60%
S1 EUR H	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.59%
S1 JPY	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.60%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.12%

* Ungeprüft. Annualisierte Sätze. Bei der Berechnung der Gesamtkostenquote werden die von der AMAS am 16. Mai 2008 aufgestellten Richtlinien befolgt.

** Zur Berechnung der Gesamtkostenquote des Portefeuilles wird das Gesamtvermögen der vom Anlageverwalter verwalteten zugrundeliegenden Fonds bei der Berechnung der Nettoverwaltungsgebühr, der Verwaltungsgesellschaftsgebühr und der *taxe d'abonnement* des Portefeuilles abgezogen, um eine doppelte Gebührenbelastung zu vermeiden.

- Die Anteilklasse wurde am 30. November 2022 aufgelöst.
- Die Anteilklasse wurde am 30. November 2022 aufgelöst.
- Die Anteilklasse wurde am 31. Oktober 2022 aufgelöst.
- Die Anteilklasse wurde am 16. Dezember 2022 aufgelöst.
- Die Anteilklasse wurde am 3. Januar 2023 aufgelöst.
- Die Anteilklasse wurde am 8. Dezember 2022 aufgelöst.
- Die Anteilklasse wurde am 12. Oktober 2022 aufgelöst.

Verwaltungsgebühren für den Berichtszeitraum werden zu ihrem tatsächlichen Satz ausgewiesen, der durch Folgendes bestimmt wird:

- Maximal 1.45% bis zu \$15,000,000,000 und bis zu 1.25% bei über \$15,000,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.
- Maximal 1.95% bis zu \$15,000,000,000 und bis zu 1.75% bei über \$15,000,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.
- Maximal 0.95% bis zu \$15,000,000,000 und bis zu 0.75% bei über \$15,000,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.
- Maximal 2.00% bis zu \$15,000,000,000 und bis zu 1.85% bei über \$15,000,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.
- 1.05% bis zu \$100,000,000, 1.00% für die nächsten \$100,000,000 und 0.95% bei über \$200,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.
- 1.50% bis zu \$100,000,000, 1.45% für die nächsten \$100,000,000 und 1.40% bei über \$200,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.
- 0.50% bis zu \$100,000,000, 0.45% für die nächsten \$100,000,000 und 0.40% bei über \$200,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.

Gebühr der Verwaltungsgesellschaft

- Jährliche Gebühr in Höhe von \$50,000 oder 0.01% des tagesdurchschnittlichen NAV, je nachdem welcher Betrag niedriger ist.

Maximale Verwaltungsgebühr gemäß den Angaben im Prospekt des Fonds

- Max 1.15%
- Max 0.55%

TABELLE 2
PORTEFEUILLEUMSATZ

AB FCPI

	<u>Umsatz*</u>
AB FCPI –	
Dynamic Diversified Portfolio	187.62%
Global Equity Blend Portfolio	72.43%
Global Value Portfolio	25.05%
Emerging Markets Growth Portfolio	54.83%
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	64.16%
Japan Strategic Value Portfolio	28.19%
China Low Volatility Equity Portfolio	6.58%
Short Duration Bond Portfolio	124.87%
Global High Yield Portfolio	14.55%
American Income Portfolio	1.39%
European Income Portfolio	64.94%
Emerging Markets Debt Portfolio	152.79%
Mortgage Income Portfolio	-38.67%

* Ungeprüft.

Wie im Prospekt dargelegt, kann der Anlageverwalter bei der Umsetzung der jeweiligen Anlagestrategie der Portefeuilles einen Teil seiner Vermögensverwaltungsaufgaben an eine oder mehrere seiner 100%igen Tochtergesellschaften (die „verbundenen Unteranlageverwalter“) übertragen. Alle verbundenen Unteranlageverwalter sind zur Erbringung von Anlageverwaltungsdienstleistungen zugelassen, registriert oder besitzen eine entsprechende Genehmigung und unterliegen der Aufsicht durch die zuständige Aufsichtsbehörde.

Für den Berichtszeitraum zum 28. Februar 2023 hat der Anlageverwalter die Anlageverwaltungsdienstleistungen für die nachstehend aufgeführten Portefeuilles an die folgenden verbundenen Unteranlageverwalter übertragen:

AllianceBernstein Australia Limited:

- Asia Ex-Japan Equity Portfolio
- China Low Volatility Equity Portfolio

AllianceBernstein Limited:

- Emerging Markets Debt Portfolio
- Global Equity Blend Portfolio
- Global Value Portfolio
- European Income Portfolio
- Short Duration Bond Portfolio

AllianceBernstein Hong Kong Limited:

- Emerging Markets Debt Portfolio
- Asia Ex-Japan Equity Portfolio
- China Low Volatility Equity Portfolio

AllianceBernstein (Singapore) Ltd.:

- Emerging Markets Growth Portfolio
- China Low Volatility Equity Portfolio

AllianceBernstein (Japan) Ltd.:

- Japan Strategic Value Portfolio

Finanzinformationen zum Fonds

Der Fonds veröffentlicht Halbjahres- und Jahresberichte, in denen Aufstellungen der Bestände eines jeden Portefeuilles und deren Marktwerte zum Ende des jeweiligen Halbjahres enthalten sind.

Bitte beachten Sie, dass bei den Portefeuilles, deren Basiswährung der Yen ist, die Zahlung der Rücknahmeerlöse (der Rücknahmepreis abzüglich eines ggf. zur Anwendung kommenden Rücknahmeabschlags) von der Depotbank oder deren Vertreter normalerweise innerhalb von vier Geschäftstagen nach Annahme des Rücknahmeantrags für eine bestimmte Handelstransaktion vorgenommen wird.

Anteile der Klassen SA GB und S1A GB stehen nur solchen britischen institutionellen Anlegern zur Verfügung, die zur Zufriedenheit der Verwaltungsgesellschaft nachweisen können, dass sie gemäß den relevanten Steuerabkommen zwischen dem Land des Steuerwohnsitzes des Anlegers und den USA von der Quellensteuer auf Dividendenerträge aus den USA befreit sind, und die sich bereit erklären, der Verwaltungsgesellschaft bestimmte andere Bestätigungen und Informationen zukommen zu lassen, soweit dies erforderlich ist, um nachzuweisen, dass sie zur Anlage in diese Anteile berechtigt sind.

Anteile der Klassen SB GB und S1B GB stehen nur solchen britischen institutionellen Anlegern zur Verfügung, die zur Zufriedenheit der Verwaltungsgesellschaft nachweisen können, dass sie gemäß den relevanten Steuerabkommen zwischen

dem Land des Steuerwohnsitzes des Anlegers und den USA Anspruch auf einen reduzierten Quellensteuersatz von 15% haben, und die sich bereit erklären, der Verwaltungsgesellschaft bestimmte andere Bestätigungen und Informationen zukommen zu lassen, soweit dies erforderlich ist, um nachzuweisen, dass sie zur Anlage in diese Anteile berechtigt sind.

Informationen zu Emissions- und Rückkaufpreisen, zum Kauf und Verkauf von Wertpapieren, zur Finanzlage des Fonds und Exemplare der Jahres- und Halbjahresberichte können kostenlos angefordert werden bei:

AllianceBernstein Investor Services, ein Geschäftsbereich von AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l.
2-4, rue Eugène Ruppert
L-2453 Luxemburg

UniCredit Bank Austria AG (bis 31. Dezember 2022)
Rothschildplatz 1
1020 Wien
Österreich

Nordea Bank Danmark A/S
Strandgade 3
DK-0900 Kopenhagen C
Dänemark

Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ)
(bis 31. Dezember 2022)
Kungsträdgårdsgatan 8
SE-106 40 Stockholm
Schweden

BNP Paribas Securities Services (bis 31. Dezember 2022)
3, rue d'Antin
75002, Paris
Frankreich

ODDO BHF Aktiengesellschaft (bis 31. Dezember 2022)
Bockenheimer Landstraße 10
60323 Frankfurt am Main
Deutschland

AllianceBernstein Hong Kong Limited
39th Floor, One Island East, Taikoo Place
18 Westlands Road, Quarry Bay
Hongkong

BNP Paribas Securities Services SA, Zweigniederlassung
Mailand
Via Ansperto 5
Mailand
Italien

Allfunds Bank, S.A. Zweigniederlassung Mailand
Via Santa Margherita 7
Mailand
Italien

Société Générale Securities Services S.p.A.
Santa Chiara 19
Turin
Italien

Banca Sella Holding S.p.A.
Piazza Gaudenzio Sella 1
I-13900 Biella
Italien

CACEIS Bank Luxembourg, Zweigniederlassung Amsterdam
(bis 31. Dezember 2022)

De Ruyterkade 6
1013 AA Amsterdam
P.O. Box 192
1000 AD Amsterdam
Niederlande

CACEIS Bank Italy
Branch Piazza Cavour n°5
20121 Mailand
Italien

AllianceBernstein (Singapore) Ltd.
One Raffles Quay
#27-11 South Tower
Singapur 048583

Allfunds Bank, S.A.
Calle Nuria n° 57
Colonia Mirasierra
28034, Madrid
Spanien

UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a.s.
(bis 31. Dezember 2022)
Prague 4 - Michle
Želetavská 1525/1
140 92, Tschechische Republik

Raiffeisenbank Austria d.d. (bis 31. Dezember 2022)
Petrinjska 59
HR-10000 Zagreb
Kroatien

Proservice Finteco Spółka z o.o.
(ehemals Moventum Spółka z o.o.)
Konstruktorska 12A
02-673 Warschau

Bank Polska Kasa Opieki Spółka Akcyjna
ul.Grzybowska 53/57
00-950 Warschau, Polen

BNP PARIBAS, Paris, succursale de Zurich, wurde von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA als Schweizer Vertreter des Fonds zugelassen und fungiert außerdem als Zahl-

stelle. Der Prospekt, die Basisinformationsblätter (KIDs), die Verwaltungsbestimmungen, die Jahres- und Halbjahresberichte sowie die Aufstellung der Käufe und Verkäufe, die der Fonds im Laufe des Geschäftsjahres getätigt hat, sind auf einfache Anfrage kostenlos vom Schweizer Vertreter, BNP PARIBAS, Paris, succursale de Zurich, Selnaustrasse 16, CH-8002 Zürich, Schweiz erhältlich.

Ab 1. Januar 2023 sind Einrichtungsinformationen für Anleger im Zusammenhang mit Artikel 92 Absatz 1 Ziffer b bis f der OGAW-Richtlinie für Österreich, Kroatien, die Tschechische Republik, Dänemark, Finnland, Frankreich, Deutschland, Ungarn, Island, Liechtenstein, Luxemburg, die Niederlande, Norwegen, Portugal, Rumänien, die Slowakei und Schweden unter www.eifs.lu/alliancebernstein abrufbar. Die Einrichtungsanforderungen für Anleger im Zusammenhang mit Artikel 92 Absatz 1 Ziffer a der OGAW-Richtlinie werden von AllianceBernstein (Luxemburg) S.à r.l. bearbeitet.

Das Dokument mit wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) bzw. das Basisinformationsblatt des Fonds steht unter www.alliancebernstein.com/go/kiid zur Verfügung.

Mitteilungen an die Anteilinhaber

Soweit laut Gesetzgebung und anwendbarer Bestimmungen vorgeschrieben, werden Mitteilungen an die Anteilinhaber im *Recueil Electronique des Sociétés et Associations* (ehemals *Mémorial*) sowie in der/den anderen Tageszeitung(en) in den Ländern veröffentlicht, die die Verwaltungsgesellschaft von Zeit zu Zeit festlegen kann.

Veränderungen des Wertpapierbestands

Während des Geschäftsjahres erfolgte Änderungen des Anlageportefeuilles werden den Anteilinhabern am Hauptsitz der Verwaltungsgesellschaft kostenlos zur Verfügung gestellt.

Richtlinie zu umstrittenen Waffen

Die Verwaltungsgesellschaft sorgt dafür, dass Unternehmen weltweit auf ihre betriebliche Verwicklung in Tretminen, Streumunition und/oder Uranmunition überprüft werden. Wenn eine solche betriebliche Verwicklung bestätigt wurde, ist es die Richtlinie der Verwaltungsgesellschaft, dem Fonds die Anlage in Wertpapiere, die von solchen Unternehmen begeben werden, nicht zu gestatten.

Securities Financing Transaction Regulation

Die Security Financing Transaction Regulation (die „SFTR“) legt neue Anforderungen für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps fest.

Wertpapierfinanzierungsgeschäft wird in Artikel 3(11) des SFTR folgendermaßen definiert:

- ein Pensionsgeschäft/umgekehrtes Pensionsgeschäft;
- Wertpapier- oder Rohstoffleihe;
- ein Kauf-/Rückverkaufsgeschäft oder Verkaufs-/Rückkaufgeschäft; oder
- ein Margenleihgeschäft.

Zum 28. Februar 2023 war der Fonds in Wertpapierleihgeschäften engagiert und hielt Total-Return-Swaps (TRS), die als Transaktionstyp unter die SFT-Verordnung fallen.

Allgemeine Angaben

Zum 28. Februar 2023 belief sich das Vermögen über alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps hinweg auf folgende Beträge:

Global Equity Blend Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$1,873,031	2.01%	4.00%

Global Value Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$16,663,341	2.58%	5.13%

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$4,980,452	1.36%	2.70%

Japan Strategic Value Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	¥973,127,429	15.50%	30.85%

China Low Volatility Equity Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$1,774,537	1.44%	2.85%

Dynamic Diversified Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV
Total-Return-Swaps	\$(45,032)	(0.13)%

Angaben zur Wiederverwendung von Sicherheiten

Im Berichtszeitraum zum 28. Februar 2023 wurden keine Sicherheiten wiederverwendet.

Im Berichtszeitraum zum 28. Februar 2023 wurden keine Barsicherheiten wiederangelegt.

Angaben zur Konzentration

Zum 28. Februar 2023 waren Folgende die zehn größten Emittenten der bezüglich sämtlicher Wertpapierfinanzierungsgeschäfte erhaltenen Wertpapiersicherheiten:

Wertpapierleihe

Global Equity Blend Portfolio

Nr.	Sicherheitsemitenten	Betrag
1	US-Regierung	\$ 1,461,212
2	Britische Regierung	\$ 257,808
3	Deutsche Regierung	\$ 147,299
4	Französische Regierung	\$ 105,907

Global Value Portfolio

Nr.	Sicherheitsemitenten	Betrag
1	US-Regierung	\$ 12,700,481
2	Britische Regierung	\$ 2,794,170
3	Deutsche Regierung	\$ 2,025,891
4	Französische Regierung	\$ 51,538

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Nr.	Sicherheitsemitenten	Betrag
1	Britische Regierung	\$ 2,975,302
2	Französische Regierung	\$ 2,644,275

Japan Strategic Value Portfolio

Nr.	Sicherheitsemitenten	Betrag
1	US-Regierung	¥558,735,768
2	Britische Regierung	¥271,555,793
3	Deutsche Regierung	¥198,851,406

China Low Volatility Equity Portfolio

Nr.	Sicherheitsemitenten	Betrag
1	US-Regierung	\$ 1,018,877
2	Britische Regierung	\$ 495,193
3	Deutsche Regierung	\$ 362,614

Total-Return-Swaps

Zum 28. Februar 2023 wurden keine Wertpapiersicherheiten für Total-Return-Swaps erhalten.

Zum 28. Februar 2023 waren Folgende die zehn größten Gegenparteien bezüglich sämtlicher Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps:

Global Equity Blend Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Merrill Lynch	\$ 720,842
	2	UBS AG	\$ 685,733
	3	Citigroup Global Markets Limited	\$ 466,456

Global Value Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Merrill Lynch	\$ 9,914,185
	2	Citigroup Global Markets Limited	\$ 6,415,451
	3	UBS AG	\$ 333,705

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Societe Generale	\$ 4,709,504
	2	Barclays	\$ 270,948

Japan Strategic Value Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Merrill Lynch	¥ 973,127,429

China Low Volatility Equity Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Merrill Lynch	\$ 1,774,537

Dynamic Diversified Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Total-Return-Swaps	1	UBS AG	\$ 16,351
	2	Morgan Stanley	\$ 2,311
	3	JPMorgan Chase	\$ (9,100)
	4	Bank of America	\$ (54,594)

Verwahrung der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapierleihe

Zum 28. Februar 2023 hielten vier Depotbanken die folgenden erhaltenen Sicherheiten:

Global Equity Blend Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	\$ 1,373,070
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$ 436,595
Clearstream	Wertpapiersicherheit	\$ 105,907
CREST	Wertpapiersicherheit	\$ 56,654

Global Value Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	\$ 11,488,208
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$ 6,004,764
Clearstream	Wertpapiersicherheit	\$ 51,538
CREST	Wertpapiersicherheit	\$ 27,570

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$ 5,564,532
CREST	Wertpapiersicherheit	\$ 55,045

Japan Strategic Value Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	¥558,735,768
Euroclear	Wertpapiersicherheit	¥470,407,199

China Low Volatility Equity Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	\$ 1,018,877
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$ 857,807

Total-Return-Swaps

Zum 28. Februar 2023 wurden keine Wertpapier- und Barsicherheiten für Total-Return-Swaps erhalten.

Verwahrung der gewährten Sicherheiten

Total-Return-Swaps

Zum 28. Februar 2023 wurden keine Wertpapier- und Barsicherheiten für Total-Return-Swaps gewährt.

Erträge/Kosten

Im Berichtszeitraum zum 28. Februar 2023 belaufen sich die Erträge und Kosten für alle Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total-Return-Swaps auf Folgendes:

Wertpapierleihe

Global Equity Blend Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 13,925	80%
Für dritte Partei	\$ 3,481	20%

Global Value Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 177,666	80%
Für dritte Partei	\$ 44,417	20%

Emerging Markets Growth Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 11,567	80%
Für dritte Partei	\$ 2,892	20%

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 8,292	80%
Für dritte Partei	\$ 2,073	20%

Japan Strategic Value Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	¥ 814,119	80%
Für dritte Partei	¥ 203,530	20%

China Low Volatility Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 1,651	80%
Für dritte Partei	\$ 413	20%

Total-Return-Swaps

Dynamic Diversified Portfolio

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$ 79,771	100%
Kosten*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$ 251,772	100%

* Die Erträge (Kosten) werden während des Berichtszeitraums als realisierte Gewinne (Verluste), Änderung der unrealisierten Gewinne (Verluste) und erhaltene (gezahlte) Zinsen auf Total-Return-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte verbucht.

**Alle Renditen aus OTC-Derivatgeschäften fließen dem Portefeuille zu und unterliegen keinen Gewinnaufteilungsvereinbarungen.

Zusammenfassende Transaktionsangaben

Zum 28. Februar 2023 besitzen die verschiedenen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Returns-Swaps folgende Fälligkeiten:

Wertpapierleihe

Global Equity Blend Portfolio

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$1,873,031

Global Value Portfolio

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$16,663,341

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$4,980,452

Japan Strategic Value Portfolio

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	¥0
Ein Tag bis eine Woche	¥0
Eine Woche bis ein Monat	¥0
Ein bis drei Monate	¥0
Drei Monate bis ein Jahr	¥0
Mehr als ein Jahr	¥0
Offene Laufzeit	¥973,127,429

China Low Volatility Equity Portfolio

<u>Fälligkeit</u>	<u>Betrag</u>
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$1,774,537

*Total-Return-Swaps***Dynamic Diversified Portfolio**

<u>Fälligkeit</u>	<u>Betrag</u>
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$(52,283)
Ein bis drei Monate	\$(9,100)
Drei Monate bis ein Jahr	\$16,351
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$0

Zum 28. Februar 2023 kommen folgende Abrechnungs- und Clearing-Mechanismen für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps zum Einsatz:

*Wertpapierleihe***Global Equity Blend Portfolio**

<u>Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus</u>	<u>Betrag</u>
Tri-party	\$1,873,031

Die zusammenfassenden Transaktionsangaben für Sicherheitspositionen (einschließlich Barmittel), die zum 28. Februar 2023 für sämtliche Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps erhalten wurden, lauten folgendermaßen:

*Wertpapierleihe***Global Equity Blend Portfolio**

<u>Gegenpartei</u>	<u>Art der Sicherheit</u>	<u>Betrag</u>	<u>Qualität*</u>	<u>Laufzeit der Sicherheit</u>	<u>Währung der Sicherheit</u>	<u>Sitzland der Gegenpartei</u>
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 6.25%, 01/04/2030	\$137,221	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 1.50%, 11/30/2028	\$137,220	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 1.63%, 05/15/2026	\$137,219	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 05/15/2025	\$137,219	AA+	>1 Jahr	\$	USA
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 12/31/2024	\$129,612	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.13%, 05/15/2023	\$119,619	AA+	1 Monat bis 3 Monate	\$	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 2.63%, 07/31/2029	\$118,815	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 3.50%, 04/25/2026	\$105,907	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 0.25%, 05/15/2024	\$88,166	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 0.50%, 04/30/2027	\$88,165	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 4.13%, 09/30/2027	\$88,142	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 4.75%, 12/07/2020	\$79,237	AA	Weniger als ein Monat	£	USA
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.75%, 07/15/2028	\$73,310	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.63%, 06/07/2025	\$68,365	AA	>1 Jahr	£	USA

Global Equity Blend Portfolio (Fortsetzung)

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 2.63%, 04/15/2025	\$66,715	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.88%, 08/15/2028	\$57,615	AA+	>1 Jahr	\$	USA
UBS AG	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.00%, 04/11/2023	\$56,654	AA	1 Monat bis 3 Monate	£	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 0.13%, 07/15/2026	\$51,114	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 5.00%, 03/07/2025	\$50,482	AA	>1 Jahr	£	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 0.00%, 06/15/2023	\$48,287	AA+	3 Monate bis 1 Jahr	\$	USA
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.63%, 01/15/2026	\$41,374	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 0.13%, 10/15/2024	\$38,404	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 1.75%, 01/31/2029	\$29,927	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 10/10/2025	\$10,078	AAA	>1 Jahr	€	USA
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.63%, 10/15/2024	\$8,065	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 01/31/2028	\$3,070	AA	>1 Jahr	£	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 11/15/2027	\$2,224	AA+	>1 Jahr	\$	USA

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Global Value Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 6.25%, 01/04/2030	\$1,887,275	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 1.50%, 11/30/2028	\$1,887,274	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 1.63%, 05/15/2026	\$1,887,262	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 05/15/2025	\$1,887,258	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 0.25%, 05/15/2024	\$1,212,601	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 0.50%, 04/30/2027	\$1,212,588	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 4.13%, 09/30/2027	\$1,212,273	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 4.75%, 12/07/2020	\$1,089,802	AA	Weniger als ein Monat	£	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.63%, 06/07/2025	\$940,261	AA	>1 Jahr	£	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.88%, 08/15/2028	\$792,416	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 0.13%, 07/15/2026	\$703,001	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 5.00%, 03/07/2025	\$694,317	AA	>1 Jahr	£	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 0.00%, 06/15/2023	\$664,126	AA+	3 Monate bis 1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 0.13%, 10/15/2024	\$528,192	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 1.75%, 01/31/2029	\$411,600	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 10/10/2025	\$138,616	AAA	>1 Jahr	€	USA
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 12/31/2024	\$63,074	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.13%, 05/15/2023	\$58,212	AA+	1 Monat bis 3 Monate	\$	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 2.63%, 07/31/2029	\$57,820	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz

Global Value Portfolio (Fortsetzung)

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
UBS AG	Französische Staatsanleihe 3.50%, 04/25/2026	\$51,538	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 01/31/2028	\$42,220	AA	>1 Jahr	£	USA
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.75%, 07/15/2028	\$35,675	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 2.63%, 04/15/2025	\$32,466	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 11/15/2027	\$30,584	AA+	>1 Jahr	\$	USA
UBS AG	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.00%, 04/11/2023	\$27,570	AA	1 Monat bis 3 Monate	£	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.63%, 01/15/2026	\$20,134	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.63%, 10/15/2024	\$3,925	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 08/10/2028	\$956,330	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Societe Generale	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 10/04/2023	\$956,273	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 09/06/2023	\$956,113	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.00%, 01/31/2032	\$687,209	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2024	\$535,519	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.00%, 04/22/2024	\$525,059	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.38%, 10/22/2026	\$354,944	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.63%, 10/22/2028	\$341,529	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Barclays	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.50%, 01/31/2029	\$55,186	AA	>1 Jahr	£	Großbritannien
Barclays	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2023	\$55,181	AA	Weniger als ein Monat	€	Großbritannien
Barclays	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 04/26/2023	\$55,139	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Großbritannien
Barclays	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.88%, 10/22/2029	\$55,045	AA	>1 Jahr	£	Großbritannien
Barclays	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 07/26/2023	\$54,701	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 03/15/2023	\$31,349	AA	Weniger als ein Monat	€	Großbritannien

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Japan Strategic Value Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 6.25%, 01/04/2030	¥185,245,591	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 1.50%, 11/30/2028	¥185,245,551	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 1.63%, 05/15/2026	¥185,244,282	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 05/15/2025	¥185,243,946	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 4.75%, 12/07/2020	¥106,969,584	AA	Weniger als ein Monat	£	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.63%, 06/07/2025	¥92,291,385	AA	>1 Jahr	£	USA

Japan Strategic Value Portfolio (Fortsetzung)

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 5.00%, 03/07/2025	¥68,150,715	AA	>1 Jahr	£	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 10/10/2025	¥13,605,815	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 01/31/2028	¥4,144,109	AA	>1 Jahr	£	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 11/15/2027	¥3,001,989	AA+	>1 Jahr	\$	USA

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

China Low Volatility Equity Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 6.25%, 01/04/2030	\$337,803	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 1.50%, 11/30/2028	\$337,803	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 1.63%, 05/15/2026	\$337,800	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 05/15/2025	\$337,800	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 4.75%, 12/07/2020	\$195,063	AA	Weniger als ein Monat	£	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.63%, 06/07/2025	\$168,297	AA	>1 Jahr	£	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 5.00%, 03/07/2025	\$124,276	AA	>1 Jahr	£	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 10/10/2025	\$24,811	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 01/31/2028	\$7,557	AA	>1 Jahr	£	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 11/15/2027	\$5,474	AA+	>1 Jahr	\$	USA

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l.
2-4, rue Eugène Ruppert
L-2453 Luxembourg
RCS: B34405

**VERWALTUNGSRAT DER
VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**

Silvio Cruz
Bertrand Reimmel
Steven Eisenberg
Eileen Koo
John Schiavetta

ANLAGEVERWALTER*

AllianceBernstein L.P.
501 Commerce Street
Nashville, TN 37203
Vereinigte Staaten von Amerika

VERBUNDENE UNTERANLAGEVERWALTER

AllianceBernstein Limited
60 London Wall,
London EC2M 5SJ,
Großbritannien

AllianceBernstein Australia Limited
Aurora Place, Level 32F,
88 Phillip Street, 32nd Floor,
Sydney New South Wales 2000,
Australien

AllianceBernstein Hong Kong Limited
39th Floor, One Island East, Taikoo Place,
18 Westlands Road, Quarry Bay,
Hongkong

AllianceBernstein (Singapore) Ltd.
One Raffles Quay,
#27-11 South Tower, 048583
Singapur

AllianceBernstein (Japan) Ltd.
Hibiya Park Front Building 14F,
2-1-6 Uchisaiwaicho, Chiyoda-ku, 14th Floor
Tokio 100-001,
Japan

VERWALTUNGSSTELLE* UND VERWAHRSTELLE

**Brown Brothers Harriman
(Luxembourg) S.C.A.**
80, Route d'Esch
L-1470 Luxembourg

REGISTER- UND TRANSFERSTELLE

AllianceBernstein Investor Services
ein Geschäftsbereich von AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l.
2-4, rue Eugène Ruppert
L-2453 Luxembourg

VERTRIEBSSTELLE

AllianceBernstein Investments
ein Geschäftsbereich von AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l.
2-4, rue Eugène Ruppert
L-2453 Luxembourg

UNABHÄNGIGER WIRTSCHAFTSPRÜFER

Ernst & Young S.A.
35E, Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxembourg

* Von der Verwaltungsgesellschaft delegiert.

RECHTSBERATER

In Luxemburg **Elvinger Hoss Prussen, société anonyme**
2, place Winston Churchill
B.P. 425
L-2014 Luxemburg

In den Vereinigten Staaten **Dechert LLP**
One International Place
40th Floor
100 Oliver Street
Boston, MA 02110
Vereinigte Staaten von Amerika



ALLIANCEBERNSTEIN®

ABI-SRS-SW-SZ-0223