



ALLIANCEBERNSTEIN®

JAHRESBERICHT

AB FCP I

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

Multi-Asset/Asset Allocation

- DYNAMIC DIVERSIFIED PORTFOLIO

Equity

- GLOBAL EQUITY BLEND 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.

Nachhaltigkeitsbezogene Informationen, die gemäss Verordnung (EU) 2019/2088 (SFDR) erforderlich sind, sind im Abschnitt „Informationen für Anteilhaber“ verfügbar.

Das [A/B] Logo ist eine Dienstleistungsmarke von AllianceBernstein, und AllianceBernstein® ist ein eingetragenes Warenzeichen, das mit Erlaubnis des Inhabers, AllianceBernstein L.P., verwendet wird.

	Seite
Brief an die Anteilhaber	1
Wertentwicklung der Anteile	2
Verzeichnis der Anlagewerte	11
Zusammensetzung des Fondsvermögens.	118
Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens.	122
Umlaufende Anteile	125
Statistische Informationen	131
Anmerkungen zum Jahresabschluss	144
Tabelle 1 – Gebührenstruktur.	163
Tabelle 2 – Portefeuilleumsatz.	174
Bericht des unabhängigen Wirtschaftsprüfers	175
Informationen für die Anteilhaber (ungeprüft)	177

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

20. September 2024

Sehr geehrte Anteilinhaber,

der vorliegende Bericht bietet Ihnen eine aktuelle Übersicht über AB FCP I (der „Fonds“) für den Jahresberichtszeitraum zum 31. August 2024.

In dem Zwölfmonatszeitraum zum 31. August 2024 verzeichneten US-Aktien, internationale Aktien und Schwellenmarkt-Aktien Kursgewinne. In der ersten Hälfte des Berichtszeitraums begannen die Zentralbanken – angeführt von der US-Notenbank (die „Fed“) –, ihre Zinserhöhungen zu pausieren, bekräftigten jedoch erneut ihre restriktive Rhetorik „längerfristig höher“. Im Oktober belastete Gegenwind durch höhere Renditen bei Staatsanleihen, Konflikte im Nahen Osten und die Sorge, dass die Stärke der US-Wirtschaft eine weitere Straffung rechtfertigen könnte, die Stimmung der Anleger weltweit und führte zu kurzfristigen Korrekturen bei allen wichtigen Indizes. Die globalen Aktienmärkte setzten zu einer Rally an, als die Erwartungen einer sanften Landung in den USA an Dynamik gewannen. Eine Reihe stabilerer Inflationsdaten im ersten Quartal 2024 dämpfte jedoch die Zinssenkungserwartungen.

Zum Ende des Berichtszeitraums nahm die Marktvolatilität zu, ausgelöst durch Anzeichen einer schwächeren US-Wirtschaft, wachsende Befürchtungen, dass die Fed mit ihrer Geldpolitik hinter der Kurve zurückbleibt, und die Neubewertung der Ertragsaussichten durch die Anleger. Die Fed signalisierte auf ihrer Sitzung im September eine erste Zinssenkung, die Aktienmärkte blieben jedoch volatil, da sich die Arbeitsmarktbedingungen weiter verschlechterten. Innerhalb der Large-Cap-Märkte legten sowohl Wachstums- als auch Substanzwerte zu, wobei Wachstumswerte relativ gesehen besser abschnitten als Substanzwerte. Large-Cap-Aktien entwickelten sich besser als Small-Cap-Aktien, obwohl beide in absoluten Zahlen stiegen.

Die Renditen festverzinslicher Staatsanleihen waren in allen wichtigen Industriemärkten äusserst volatil, und die Renditen der Staatsanleihen aus Industriemärkten begannen, sich

aufgrund des Wachstums der einzelnen Länder, der Inflationserwartungen und der Zinsentscheidungen der Zentralbanken unterschiedlich zu entwickeln. Die meisten Zentralbanken hoben die Zinsen deutlich an, um die Inflation zu bekämpfen, und setzten dann weitere Zinserhöhungen aus, während mehrere Zentralbanken, darunter die Schweizerische Nationalbank, die EZB, die Bank of Canada und die Bank of England, mit Zinssenkungen begannen. Die Anleger erhöhten ihre Erwartungen hinsichtlich der Anzahl und des Ausmasses der Zinssenkungen bis 2024, einschließlich derer der Fed, da die Renditen von Staatsanleihen ab Juni stark fielen. Die Renditen der Staatsanleihen waren insgesamt gut, mit den höchsten Renditen in Südkorea, der Schweiz und Schweden und den geringsten Renditen in Japan und Frankreich.

Insgesamt übertrafen die Investment-Grade-Unternehmensanleihen der Industrieländer deutlich die Staatsanleihen, auch in den USA und der Eurozone. Hochverzinsliche Unternehmensanleihen entwickelten sich positiv und übertrafen Staatsanleihen deutlich – insbesondere in den USA und der Eurozone. Staatsanleihen der Schwellenländer in Hartwährung übertrafen andere Kreditrisikosektoren, allen voran die Renditen hochverzinslicher Staatsanleihen. Unternehmensanleihen der Schwellenländer in Hartwährung erzielten starke relative positive Renditen und übertrafen Unternehmensanleihen aus Industrieländern nach Bonität. Staatsanleihen in Lokalwährung legten zu, blieben jedoch hinter den Staatsanleihen der Industrieländer und anderen Kreditrisikosektoren zurück, da der US-Dollar im Berichtszeitraum gegenüber fast allen Währungen der Industrieländer an Wert verlor und sich gegenüber den Währungen der Schwellenländer uneinheitlich entwickelte.

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>Global Equity Blend Portfolio</u>				
Klasse				
A	8.54%	16.43%	10.27%	196.20%
A EUR	6.10%	14.20%	2.18%	215.55%
A EUR H	7.47%	14.11%	6.63%	63.93%
A SGD	5.28%	12.44%	6.63%	85.92%
B	8.01%	15.27%	9.17%	140.10%
B SGD	4.74%	11.32%	5.58%	53.70%
C	8.31%	15.91%	9.76%	127.19%
C EUR	6.01%	13.85%	1.85%	4.67%
I	8.99%	17.40%	11.14%	251.50%
I EUR	6.57%	15.14%	3.02%	274.44%
S HKD	9.16%	18.06%	12.36%	233.21%
S1	9.20%	17.92%	11.63%	242.17%
S1 EUR	6.80%	15.66%	3.49%	285.15%
S1 GBP	4.99%	13.73%	2.41%	329.11%
S1 SGD	5.91%	13.85%	7.98%	130.19%
<u>Emerging Markets Growth Portfolio</u>				
Klasse				
A	6.60%	10.87%	-2.92%	357.00%
A AUD H	5.63%	8.76%	-5.84%	25.00%
A EUR	4.21%	8.76%	-10.04%	151.40%
A HKD	6.17%	10.25%	-2.99%	35.83%
A PLN H	6.66%	10.76%	-0.47%	4.48%
A SGD	3.39%	7.07%	-6.09%	40.21%
A SGD H	5.58%	8.72%	-4.58%	-0.27%
AD	6.58%	10.84%	-2.93%	27.39%
B	6.09%	9.81%	-3.91%	234.70%
C	6.37%	10.39%	-3.37%	137.30%
C EUR	4.00%	8.29%	-10.41%	120.07%
ED	6.02%	9.80%	-3.91%	-11.97%
I	7.04%	11.80%	-2.15%	220.18%
I AUD H	6.12%	9.69%	-5.01%	38.80%
I EUR	4.67%	9.66%	-9.29%	204.37%
N	6.37%	10.39%	-3.32%	48.07%
S1	7.12%	11.98%	-1.97%	191.11%
S1 EUR	4.76%	9.85%	-9.09%	241.30%
S1 GBP	2.99%	8.03%	-10.05%	310.57%
<u>Asia Ex-Japan Equity Portfolio</u>				
Klasse				
A	11.16%	18.74%	-1.51%	70.67%
A AUD H	10.26%	16.93%	-4.57%	61.13%
A EUR	8.68%	16.51%	-8.73%	131.73%
A HKD	10.70%	18.10%	-1.61%	71.75%
A SGD H	10.15%	16.69%	-3.38%	17.93%
AD	11.16%	18.74%	-1.48%	70.76%
AD AUD H	10.28%	16.93%	-4.53%	61.43%
AD CAD H	10.60%	17.85%	-2.89%	18.64%
AD EUR	8.63%	16.45%	-8.70%	131.84%
AD EUR H	10.22%	16.78%	-4.94%	16.08%
AD GBP H	11.07%	18.37%	-3.60%	32.92%
AD HKD	10.70%	18.10%	-1.61%	71.83%
AD NZD H	10.74%	18.13%	-3.72%	55.90%
AD ZAR H	12.06%	21.39%	-0.18%	138.37%
AY JPY	8.39%	19.34%	3.13%	169.66%
BY JPY	8.11%	18.76%	2.65%	153.89%
C	10.88%	18.21%	-1.98%	59.67%
C EUR	8.67%	16.18%	-9.24%	117.12%
ED	10.55%	17.61%	-2.53%	-0.27%
ED AUD H	9.70%	15.73%	-5.49%	2.43%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Asia Ex-Japan Equity Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
I	11.62%	19.73%	-0.70%	92.20%
I EUR	9.08%	17.44%	-8.04%	160.86%
I GBP	7.31%	15.51%	-9.00%	64.33%
S	12.22%	20.98%	0.29%	125.27%
S HKD	11.76%	20.30%	0.21%	97.11%
S1	11.73%	19.89%	-0.61%	96.87%
S1 EUR	9.23%	17.65%	-7.87%	167.57%
SD	12.21%	20.98%	0.29%	82.94%
Japan Strategic Value Portfolio				
Klasse				
A	1.16%	12.97%	18.45%	61.00%
A CZK H	2.37%	18.40%	26.67%	51.46%
A EUR	1.45%	10.29%	4.89%	38.81%
A EUR H	1.76%	15.85%	20.73%	157.73%
A SGD	0.60%	8.57%	9.38%	4.42%
A SGD H	1.91%	15.98%	22.67%	64.00%
A USD	3.74%	12.48%	13.11%	28.31%
A USD H	2.63%	17.77%	23.95%	233.60%
AD	1.16%	12.97%	18.46%	99.67%
AD AUD H	1.37%	15.61%	21.60%	112.58%
AD NZD H	2.20%	17.21%	23.45%	133.02%
AD USD H	2.68%	17.82%	23.86%	110.86%
AD ZAR H	3.67%	20.90%	27.41%	253.61%
C	0.62%	11.99%	17.49%	47.42%
C EUR	0.90%	9.35%	3.98%	36.16%
C EUR H	1.20%	14.82%	19.72%	136.53%
C USD	3.20%	11.45%	12.16%	17.55%
I	1.55%	13.86%	19.37%	87.01%
I EUR	1.82%	11.17%	5.64%	72.72%
I EUR H	2.17%	16.77%	21.60%	188.33%
I USD	4.16%	13.34%	14.02%	49.18%
I USD H	3.05%	18.71%	24.87%	269.20%
S1 EUR	1.90%	11.30%	5.77%	70.64%
S1 USD	4.21%	13.45%	14.13%	57.68%
SD	1.95%	14.74%	20.30%	149.48%
Short Duration Bond Portfolio				
Klasse				
A	2.49%	5.35%	1.75%	126.14%
A EUR	0.26%	3.31%	-5.71%	29.00%
A2	2.59%	5.26%	1.75%	82.17%
A2 EUR	0.23%	3.24%	-5.72%	28.67%
A2 EUR H	1.73%	3.52%	-0.73%	-5.93%
A2 HKD	2.12%	4.65%	1.67%	38.26%
A2 SGD H	1.63%	3.67%(1)	-	3.67%
AA	2.51%	5.18%	1.79%	6.91%
AA AUD H	1.93%	3.92%	0.33%	7.79%
AA CAD H	2.13%	4.46%	1.30%	3.39%
AA GBP H	2.42%	4.95%	0.81%	-0.54%
AA HKD	2.11%	4.65%	1.67%	7.55%
AA SGD H	1.63%	3.43%	0.72%	2.52%
AJ	2.64%	5.53%	1.93%	102.72%
AT	2.63%	5.36%	1.76%	63.90%
AT AUD H	1.92%	3.92%	0.36%	24.71%
AT CAD H	2.20%	4.62%	1.27%	9.76%
AT EUR	0.26%	3.16%	-5.70%	68.63%
AT EUR H	1.71%	3.52%	-0.70%	-6.78%
AT GBP H	2.40%	4.92%	0.81%	2.50%
AT HKD	2.16%	4.70%	1.66%	38.21%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Short Duration Bond Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
AT NZD H	2.39%	5.03%	1.42%	16.86%
AT SGD H	1.68%	3.45%	0.75%	1.64%
AX	2.66%	5.41%	2.05%	197.55%
C	2.29%	4.80%	1.34%	60.42%
C2	2.32%	4.88%	1.30%	56.42%
I	2.80%	5.86%	2.37%	158.34%
I2	2.80%	5.83%	2.33%	51.03%
I2 EUR H	2.00%	4.16%	-0.20%	1.87%
IT	2.84%	5.89%	2.33%	12.88%
N2	2.26%	4.70%	1.28%	-0.40%
NT	2.30%	4.68%	1.27%	-0.50%
S	3.09%	6.38%	2.85%	9.90%
S1 2	2.95%	6.07%	2.63%	18.73%
S1 2 EUR	0.69%	4.13%	-4.91%	34.22%
S1 EUR H	2.08%	4.36%	-	4.71%
S1T	2.97%	6.14%	-	6.71%
SA	3.08%	6.38%	2.85%	21.51%
Global High Yield Portfolio				
Klasse				
A	5.31%	12.48%	6.72%	275.51%
A EUR	2.74%	10.08%	-0.82%	206.46%
A2	5.21%	12.36%	7.01%	310.38%
A2 CHF H	2.84%	7.61%	2.48%	3.73%
A2 EUR	2.81%	10.19%	-0.80%	227.49%
A2 EUR H	4.22%	10.28%	3.99%	63.00%
A2 HKD	4.76%	11.73%	6.93%	224.71%
A2 PLN H	5.17%	12.63%	9.67%	18.31%
A2 SGD	2.02%	8.50%	3.50%	72.03%
A2 SGD H	4.20%	10.29%	5.55%	52.27%
AA	5.21%	12.40%	6.99%	37.74%
AA AUD H	4.49%	10.56%	5.00%	31.47%
AA CAD H	4.65%	11.37%	6.07%	24.10%
AA EUR H	4.22%	10.30%	3.91%	9.64%
AA GBP H	4.82%	11.62%	5.41%	18.90%
AA HKD	4.76%	11.73%	6.92%	34.21%
AA NZD H	5.08%	11.92%	6.19%	35.30%
AA RMB H	3.82%	9.48%	3.86%	46.88%
AA SGD H	4.27%	10.33%	5.57%	27.44%
AA ZAR H	6.55%	15.37%	9.64%	111.25%
AK	5.19%	12.29%	7.03%	42.57%
AK EUR	2.87%	10.27%	-0.88%	67.84%
AK EUR H	4.26%	10.33%	3.90%	17.15%
AR EUR H	4.15%	10.20%	3.79%	11.11%
AT	5.35%	12.57%	7.11%	358.84%
AT AUD H	4.54%	10.70%	4.89%	102.66%
AT CAD H	4.72%	11.37%	6.13%	55.06%
AT EUR	2.75%	10.15%	-0.87%	172.94%
AT EUR H	4.26%	10.33%	3.90%	62.12%
AT GBP H	5.00%	11.72%	5.34%	56.30%
AT HKD	4.73%	11.71%	6.90%	225.08%
AT NZD H	5.11%	12.01%	6.04%	56.69%
AT RMB H	3.79%	9.46%	3.85%	85.30%
AT SGD	1.98%	8.42%	3.51%	108.96%
AT SGD H	4.18%	10.20%	5.57%	51.98%
B	4.67%	11.46%	5.77%	183.01%
B2	4.68%	11.23%	5.97%	262.27%
BT	4.67%	11.43%	5.79%	180.61%
BT AUD H	3.88%	9.52%	3.90%	75.77%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
C	4.98%	11.75%	6.39%	214.21%
C EUR.....	2.47%	9.51%	-1.35%	168.22%
C2	4.96%	11.81%	6.52%	151.90%
C2 EUR.....	2.57%	9.68%	-1.33%	194.32%
C2 EUR H.....	3.94%	9.69%	3.46%	26.73%
CT	4.92%	11.79%	6.51%	50.28%
EA	4.97%	11.84%	6.48%	15.29%
EA AUD H	4.19%	10.04%	4.52%	4.23%
EA ZAR H	6.26%	14.76%	9.17%	33.85%
I	5.31%	12.84%	7.41%	338.07%
I EUR	3.04%	10.73%	-0.23%	249.07%
I2	5.45%	13.03%	7.52%	136.95%
I2 AUD H	4.73%	11.17%	5.41%	102.27%
I2 CHF H	3.15%	8.14%	3.14%	9.00%
I2 EUR	3.09%	10.80%	-0.31%	192.33%
I2 EUR H	4.53%	10.82%	4.53%	75.47%
I2 SGD	2.26%	8.99%	4.05%	81.60%
I2 SGD H	4.48%	10.82%	6.16%	33.80%
IA AUD H	4.83%	11.23%	5.45%	39.02%
IQD	5.36%	12.93%	7.52%	74.16%
IT	5.49%	12.93%	7.58%	48.96%
IT AUD H	4.80%	11.32%	5.43%	45.28%
IT CAD H	5.02%	11.97%	6.63%	40.91%
IT EUR H	4.49%	10.84%	4.43%	4.40%
IT GBP H	5.23%	12.42%	5.82%	35.78%
IT HKD	5.03%	12.29%	7.46%	49.51%
IT RMB H	4.06%	10.06%	4.37%	61.75%
J	4.55%	11.07%	6.13%	192.87%
N2	4.91%	11.76%	6.43%	38.13%
NT	4.97%	11.77%	6.41%	38.30%
S1	5.56%	13.17%	7.77%	112.53%
S1 EUR H	4.63%	11.09%	-	11.57%
S1D	5.55%	13.15%	7.75%	75.16%
S1D2	5.57%	13.16%	-	25.82%
S1L GBP H	5.32%	12.52%	-	15.53%
SA	6.05%	14.18%	8.72%	61.39%
SHK	6.03%	14.12%	8.70%	60.04%
SK	5.68%	13.44%	8.01%	187.60%
W	5.54%	13.15%	7.66%	17.58%
W EUR	3.14%	10.94%	-0.23%	17.75%
W2	5.53%	13.10%	7.72%	22.07%
W2 CHF H	3.17%	8.25%	3.21%	-0.33%
W2 EUR H	4.60%	11.03%	4.68%	6.00%
WT	5.52%	13.16%	7.71%	22.10%
WT AUD H	4.83%	11.46%	5.67%	11.18%
WT CAD H	5.15%	12.24%	6.79%	12.74%
WT EUR H	4.55%	10.96%	4.68%	4.80%
WT GBP H	5.28%	12.41%	5.98%	10.42%
WT RMB H	4.16%	10.22%	4.49%	15.77%

American Income Portfolio

Klasse				
A	5.35%	9.50%	1.52%	399.10%
A EUR.....	2.94%	7.41%	-5.83%	126.72%
A2	5.35%	9.46%	1.61%	256.41%
A2 CHF H.....	2.98%	4.64%	-2.87%	-0.80%
A2 DUR PH	3.32%	9.10%	9.34%	43.07%
A2 EUR	2.98%	7.37%	-5.81%	124.84%
A2 EUR H.....	4.34%	7.38%	-1.43%	23.27%
A2 HKD	4.89%	8.83%	1.54%	116.50%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
American Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
A2 PLN H	5.34%	9.61%	4.05%	11.28%
A2 SGD	2.15%	5.69%	-1.73%	46.26%
A2 SGD H	4.36%	7.43%	0.26%	38.80%
AA	5.41%	9.50%	1.61%	31.47%
AA AUD H	4.56%	7.80%	-0.42%	28.24%
AA CAD H	4.85%	8.56%	0.79%	19.56%
AA DUR PH	3.41%	9.11%	9.38%	42.02%
AA EUR H	4.31%	7.32%	-1.37%	3.91%
AA GBP H	5.07%	8.75%	0.02%	13.83%
AA HKD	4.88%	8.81%	1.54%	27.05%
AA NZD H	5.28%	9.02%	0.70%	30.01%
AA RMB H	3.90%	6.62%	-1.42%	39.61%
AA SGD H	4.31%	7.44%	0.26%	21.67%
AA ZAR H	6.70%	12.41%	4.19%	105.58%
AK	5.34%	9.51%	1.58%	30.30%
AK EUR	2.98%	7.35%	-5.85%	53.36%
AK EUR H	4.35%	7.40%	-1.49%	7.33%
AR EUR	2.99%	7.36%	-5.81%	27.01%
AR EUR H	4.39%	7.33%	-1.43%	2.06%
AT	5.37%	9.54%	1.54%	174.74%
AT AUD H	4.71%	7.83%	-0.33%	69.03%
AT CAD H	4.89%	8.58%	0.83%	42.90%
AT DUR PH	3.32%	9.09%	9.34%	42.96%
AT EUR	2.94%	7.24%	-5.83%	141.30%
AT EUR H	4.37%	7.47%	-1.42%	25.15%
AT GBP H	5.02%	8.82%	0.00%	29.50%
AT HKD	4.90%	8.84%	1.54%	116.47%
AT NZD H	5.19%	9.05%	0.70%	40.54%
AT RMB H	3.90%	6.62%	-1.46%	59.64%
AT SGD	2.05%	5.62%	-1.70%	64.04%
AT SGD H	4.36%	7.36%	0.39%	38.79%
B	4.86%	8.66%	0.93%	300.15%
B2	4.93%	8.68%	0.89%	193.69%
BT	4.86%	8.66%	0.83%	137.77%
C	5.03%	8.85%	1.25%	319.86%
C EUR	2.67%	6.67%	-6.15%	100.54%
C2	5.08%	8.96%	1.16%	319.05%
C2 EUR	2.75%	6.89%	-6.23%	101.52%
C2 EUR H	4.13%	6.95%	-1.87%	16.00%
CT	5.09%	8.97%	1.15%	29.69%
EA	5.06%	8.95%	1.12%	6.69%
EA AUD H	4.42%	7.28%	-0.85%	-2.08%
EA ZAR H	6.43%	11.89%	3.71%	26.70%
I	5.73%	10.12%	2.07%	290.63%
I EUR	3.26%	7.91%	-5.26%	157.20%
I2	5.60%	10.06%	2.16%	128.62%
I2 AUD H	4.90%	8.33%	0.27%	8.40%
I2 CHF H	3.25%	5.31%	-2.33%	5.87%
I2 EUR	3.26%	7.94%	-5.28%	166.61%
I2 EUR H	4.68%	8.01%	-0.89%	35.80%
I2 HKD	5.19%	9.45%	2.22%	33.39%
I2 SGD H	4.58%	7.98%	0.86%	26.27%
IA	5.63%	10.01%	2.22%	34.34%
IA AUD H	4.94%	8.41%	0.16%	26.33%
IT	5.57%	10.03%	2.16%	38.85%
IT AUD H	4.92%	8.47%	0.18%	34.80%
IT CAD H	5.20%	9.23%	1.35%	26.70%
IT EUR H	4.68%	7.94%	-0.89%	11.42%
IT GBP H	5.43%	9.40%	0.55%	21.52%
IT HKD	5.18%	9.42%	2.09%	39.00%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
American Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
IT JPY	2.98%	10.57%	7.01%	99.45%
IT JPY H	2.48%	3.63%	-3.24%	5.87%
IT NZD H	5.42%	9.53%	1.17%	31.81%
IT RMB H	4.19%	7.20%	-0.88%	9.04%
IT SGD H	4.62%	8.02%	0.78%	33.77%
J	4.98%	8.60%	1.02%	201.00%
N2	5.02%	8.87%	1.08%	22.73%
NT	5.00%	8.86%	1.01%	22.68%
S	6.02%	10.88%	2.91%	51.53%
S1	5.74%	10.31%	2.44%	66.93%
S1D	5.73%	10.24%	2.48%	52.79%
S1D2	5.73%	10.32%	2.39%	4.01%
SA	5.99%	10.86%	2.91%	47.43%
SHK	5.98%	10.83%	2.89%	40.03%
W	5.65%	10.13%	2.35%	18.54%
W2	5.69%	10.27%	2.34%	18.87%
W2 CHF H	3.35%	5.45%	-2.13%	-3.27%
W2 EUR H	4.71%	8.10%	-0.70%	2.27%
WT	5.75%	10.26%	2.29%	18.87%
WT AUD H	4.99%	8.51%	0.40%	9.68%
WT EUR H	4.78%	8.16%	-0.66%	-0.44%
WT GBP H	5.45%	9.62%	0.82%	4.33%
WT HKD	5.25%	9.61%	2.26%	18.50%
WT SGD H	4.71%	8.10%	1.03%	12.13%

European Income Portfolio

Klasse				
A	3.22%	9.35%	2.08%	116.15%
A USD	5.48%	11.34%	10.23%	117.70%
A2	3.22%	9.37%	2.08%	114.70%
A2 CHF H	1.81%	6.50%	0.54%	4.93%
A2 PLN H	4.24%	11.61%	7.65%	20.24%
A2 USD	5.61%	11.51%	10.14%	119.21%
A2 USD H	4.12%	11.25%	4.96%	36.47%
AA	3.18%	9.31%	2.07%	22.06%
AA AUD H	3.49%	9.71%	2.94%	42.86%
AA HKD H	3.45%	10.10%	3.69%	33.82%
AA RMB H	2.76%	8.46%	1.93%	46.64%
AA SGD H	3.19%	9.27%	3.65%	36.12%
AA USD H	4.08%	11.32%	4.92%	45.36%
AK	3.27%	9.36%	2.13%	27.70%
AR	3.17%	9.28%	2.15%	14.21%
AT	3.05%	9.35%	2.07%	110.14%
AT AUD H	3.44%	9.70%	3.02%	97.87%
AT SGD H	3.12%	9.20%	3.61%	35.98%
AT USD	5.64%	11.51%	10.23%	54.95%
AT USD H	4.06%	11.24%	4.99%	83.20%
B USD	5.22%	10.70%	9.32%	81.71%
B2	2.91%	8.61%	1.40%	80.30%
B2 USD	5.17%	10.73%	9.36%	80.76%
C	2.98%	8.97%	1.51%	89.45%
C USD	5.37%	11.06%	9.52%	92.06%
C2	2.98%	8.86%	1.60%	100.30%
C2 USD	5.33%	10.97%	9.67%	104.52%
C2 USD H	3.88%	10.75%	4.50%	28.47%
CK	2.95%	8.89%	1.55%	21.49%
CT USD H	3.86%	10.78%	4.57%	28.59%
I	3.53%	9.84%	2.76%	148.84%
I USD	5.82%	11.95%	10.70%	229.23%
I2	3.54%	10.00%	2.62%	95.59%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
European Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
I2 AUD H	3.76%	10.29%	3.60%	113.67%
I2 CHF H	2.13%	7.09%	1.13%	8.73%
I2 USD	5.82%	12.06%	10.74%	69.68%
I2 USD H	4.37%	11.86%	5.54%	97.47%
IA	3.47%	9.91%	2.63%	21.34%
IA HKD H	3.78%	10.72%	4.32%	36.66%
IA USD H	4.44%	11.97%	4.84%	43.56%
IT	3.53%	9.96%	2.65%	21.31%
IT USD H	4.42%	11.93%	5.56%	47.25%
NT USD H	3.74%	10.66%	4.35%	20.45%
S1	3.61%	10.19%	2.87%	75.22%
S1 USD	6.00%	12.39%	10.99%	43.70%
S1 USD H	4.49%	12.12%	5.73%	86.20%
S1D	3.60%	10.18%	2.89%	24.12%
SA USD H	4.76%	12.67%	6.33%	64.32%
SHK	3.85%	10.75%	3.38%	29.37%
W2	3.60%	10.15%	2.86%	5.60%
W2 CHF H	2.14%	7.22%	1.24%	5.00%
W2 USD H	4.46%	12.02%	5.74%	15.53%
WA	3.59%	10.18%	2.78%	5.55%
WA USD H	4.46%	12.12%	5.73%	15.56%
WT	3.61%	10.10%	2.84%	5.57%
WT USD H	4.47%	12.10%	5.69%	15.50%
Emerging Markets Debt Portfolio				
Klasse				
A	7.00%	14.79%	5.63%	123.09%
A EUR	4.55%	12.63%	-2.23%	141.49%
A2	7.03%	14.89%	5.59%	124.27%
A2 CHF H	4.64%	9.82%	1.13%	-8.33%
A2 EUR	4.61%	12.67%	-2.14%	142.97%
A2 EUR H	5.97%	12.57%	2.38%	28.93%
A2 HKD	6.58%	14.21%	5.52%	68.46%
A2 PLN H	7.05%	14.63%	8.37%	6.27%
A2 SGD H	6.00%	12.65%	4.22%	35.40%
AA	7.03%	14.81%	5.63%	29.36%
AA AUD H	6.35%	13.04%	3.41%	22.88%
AA CAD H	6.52%	13.76%	4.82%	12.94%
AA EUR H	5.94%	12.53%	2.44%	-0.70%
AA GBP H	6.72%	14.08%	3.63%	7.73%
AA HKD	6.59%	14.23%	5.52%	23.01%
AA NZD H	6.87%	14.45%	4.25%	21.22%
AA ZAR H	8.44%	17.97%	7.95%	96.39%
AI	7.01%	14.85%	5.60%	-3.01%
AI AUD H	6.29%	13.03%	3.47%	-7.58%
AR EUR	4.63%	12.58%	-2.17%	26.97%
AT	7.00%	14.90%	5.56%	124.15%
AT AUD H	6.28%	13.11%	3.37%	66.99%
AT CAD H	6.48%	13.86%	4.71%	14.33%
AT EUR	4.64%	12.71%	-2.20%	136.89%
AT EUR H	6.10%	12.65%	2.34%	29.19%
AT GBP H	6.79%	14.15%	3.82%	9.11%
AT HKD	6.57%	14.20%	5.52%	68.46%
AT NZD H	6.89%	14.41%	4.26%	27.71%
AT SGD H	5.99%	12.67%	4.15%	35.28%
BT	6.52%	13.77%	4.56%	86.50%
C	6.75%	14.26%	5.16%	105.55%
C EUR	4.36%	12.09%	-2.47%	122.83%
C2	6.76%	14.35%	5.13%	106.20%
C2 EUR	4.44%	12.23%	-2.58%	123.56%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Emerging Markets Debt Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
C2 EUR H	5.75%	12.06%	1.94%	21.40%
CT	6.77%	14.31%	5.23%	16.02%
EA	6.76%	14.31%	5.01%	-0.93%
EA AUD H	6.03%	12.51%	2.90%	-8.83%
EA ZAR H	8.18%	17.37%	7.44%	14.99%
EI	6.74%	14.28%	5.08%	-4.67%
EI AUD H	6.03%	12.48%	2.85%	-9.28%
I	7.32%	15.49%	6.25%	146.89%
I2	7.33%	15.49%	6.20%	148.00%
I2 AUD H	6.60%	13.66%	4.02%	9.87%
I2 CHF H	4.94%	10.47%	1.68%	-2.20%
I2 EUR	4.93%	13.30%	-1.59%	168.77%
I2 EUR H	6.27%	13.20%	2.94%	40.07%
IT AUD H	6.61%	13.67%	4.04%	25.38%
IT EUR H	6.31%	13.23%	2.91%	4.32%
N2	6.75%	14.25%	4.99%	13.87%
NT	6.68%	14.24%	5.03%	13.92%
S	7.67%	16.29%	6.97%	78.99%
S1 2	7.37%	15.65%	6.35%	131.07%
S1 EUR H	6.36%	13.39%	3.15%	36.07%
S1 GBP H	7.21%	14.96%	4.55%	49.60%
S1L	7.39%	15.69%	-	17.48%
SA	7.69%	16.32%	6.92%	44.65%
Mortgage Income Portfolio				
Klasse				
A	4.71%	10.70%	8.59%	42.39%
A2	4.74%	10.74%	8.64%	43.00%
A2 EUR	2.37%	8.62%	0.68%	77.49%
A2 EUR H	1.20%(2)	-	-	1.20%
A2 HKD	4.31%	10.12%	8.51%	25.79%
A2X	4.76%	10.87%	8.69%	61.93%
A2X EUR	2.43%	8.74%	0.79%	29.46%
AA	4.74%	10.77%	8.59%	42.93%
AA AUD H	4.14%	9.33%	7.17%	40.75%
AA HKD	4.32%	10.11%	8.52%	40.55%
AA RMB H	3.38%	8.01%	5.67%	50.02%
AA SGD H	3.84%	8.78%	7.55%	35.94%
AA ZAR H	6.19%	13.93%	12.01%	131.32%
AR EUR H	3.92%	8.93%	5.74%	15.39%
AT	4.73%	10.72%	8.62%	42.82%
AT AUD H	4.16%	9.39%	7.19%	40.93%
AT EUR	2.42%	8.59%	0.67%	77.25%
AT GBP H	4.54%	10.32%	7.39%	14.37%
AT HKD	4.32%	10.11%	8.49%	25.63%
AT SGD H	3.85%	8.84%	7.62%	35.80%
AX	4.79%	10.68%	8.82%	109.52%
AX EUR	2.37%	8.63%	0.61%	55.50%
BX	4.55%	10.37%	8.33%	83.18%
BX EUR	2.16%	8.18%	0.34%	10.90%
C	4.48%	10.19%	8.19%	35.89%
C2	4.55%	10.25%	8.17%	36.20%
C2 EUR	2.21%	8.19%	0.23%	69.17%
CX	4.36%	10.18%	8.33%	82.70%
I	5.00%	11.29%	9.19%	51.06%
I EUR	2.57%	9.13%	1.25%	87.15%
I2	5.04%	11.37%	9.21%	51.47%
I2 EUR	2.70%	9.24%	1.29%	88.20%
I2 EUR H	4.16%	9.60%	6.39%	11.93%
IT EUR H	4.17%	9.53%	6.50%	11.16%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Mortgage Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
IX	5.07%	11.28%	9.42%	107.89%
N2	4.41%	10.12%	8.05%	18.27%
NT	4.40%	10.15%	8.04%	18.39%
S	5.35%	12.05%	9.98%	63.24%
S1	5.15%	11.55%	9.42%	54.87%
S1 AUD H.	4.51%	10.17%	–	21.17%
S1 EUR H.	4.27%	9.76%	6.67%	10.25%
S1L	5.14%	11.58%	–	14.88%
SA	5.39%	12.11%	9.95%	59.50%

Die Wertentwicklung der Anteilklassen der einzelnen Portefeuilles basiert auf dem Nettoinventarwert zum 31. August 2024, 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 Anteilklassen umfasst die während des Geschäftsjahres 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 31. August 2024.

(a) Die Anteilklasse wurde umbenannt. Siehe Anmerkung A.

Rendite berechnet ab Auflegungsdatum am:

- (1) 16. Oktober 2023
- (2) 18. Juni 2024

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONS-AUSRÜSTUNG			
Arista Networks, Inc.	2,560	\$ 904,799	0.9%
Calix, Inc.	17,317	644,872	0.6
		<u>1,549,671</u>	<u>1.5</u>
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Flex Ltd.	41,278	1,341,117	1.3
Halma PLC.	24,305	835,804	0.8
Keyence Corp.	2,303	1,106,461	1.1
LG Innotek Co., Ltd.	2,346	489,311	0.5
Nan Ya Printed Circuit Board Corp.	24,396	112,468	0.1
		<u>3,885,161</u>	<u>3.8</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Accenture PLC - Class A.	3,242	1,108,664	1.1
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
ASML Holding NV.	847	763,772	0.8
Lam Research Corp.	1,148	942,358	0.9
Monolithic Power Systems, Inc.	929	868,572	0.9
NVIDIA Corp.	11,603	1,385,003	1.4
NXP Semiconductors NV.	4,039	1,035,340	1.0
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	92,535	2,739,528	2.8
		<u>7,734,573</u>	<u>7.8</u>
SOFTWARE			
Adobe, Inc.	2,113	1,213,618	1.2
Bentley Systems, Inc. - Class B.	10,338	532,087	0.5
Cadence Design Systems, Inc.	3,304	888,421	0.9
Fair Isaac Corp.	470	813,235	0.8
Intuit, Inc.	1,622	1,022,176	1.0
Microsoft Corp.	9,626	4,015,554	4.0
Oracle Corp.	10,190	1,439,810	1.4
Palo Alto Networks, Inc.	2,796	1,014,252	1.0
		<u>10,939,153</u>	<u>10.8</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Samsung Electronics Co., Ltd.	16,706	927,805	0.9
Western Digital Corp.	16,072	1,054,160	1.1
		<u>1,981,965</u>	<u>2.0</u>
		<u>27,199,187</u>	<u>27.0</u>
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
Airbus SE.	6,387	981,129	1.0
BAE Systems PLC.	48,451	871,145	0.9
Hexcel Corp.	12,116	766,807	0.8
Melrose Industries PLC.	138,972	882,782	0.9
MTU Aero Engines AG.	1,801	539,303	0.5
		<u>4,041,166</u>	<u>4.1</u>
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Tetra Tech, Inc.	5,357	1,273,456	1.3
Veralto Corp.	11,920	1,340,214	1.3
Waste Management, Inc.	6,796	1,441,079	1.4
		<u>4,054,749</u>	<u>4.0</u>
BAU- UND INGENIEURWESEN			
AECOM.	9,243	925,594	0.9
Shimizu Corp.(a)	80,660	540,772	0.5
WillScot Holdings Corp.(a)	15,084	581,321	0.6
WSP Global, Inc.	4,407	734,598	0.7
		<u>2,782,285</u>	<u>2.7</u>
TRANSPORT AUF DEM LANDWEG			
ArcBest Corp.	5,012	532,799	0.5
MASCHINEN			
Amada Co., Ltd.	24,066	248,451	0.2
Hyundai Rotem Co., Ltd.	12,223	494,395	0.5
Middleby Corp. (The)	4,223	593,860	0.6
Stanley Black & Decker, Inc.	4,739	485,078	0.5
TOMRA Systems ASA.	33,828	523,026	0.5
Toyota Industries Corp.	12,393	981,953	1.0
		<u>3,326,763</u>	<u>3.3</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
PASSAGIERFLUGGESELLSCHAFTEN			
Ryanair Holdings PLC (Sponsored ADR)	4,688	\$ 522,481	0.5%
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Experian PLC	23,102	1,122,470	1.1
RELX PLC	16,124	752,689	0.8
Robert Half, Inc.	9,085	569,358	0.6
		<u>2,444,517</u>	<u>2.5</u>
		<u>17,704,760</u>	<u>17.6</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank Mandiri Persero Tbk PT	2,071,175	957,082	1.0
Eurobank Ergasias Services & Holdings SA - Class A	214,123	488,217	0.5
KB Financial Group, Inc.	9,418	607,298	0.6
NatWest Group PLC	174,311	794,105	0.8
NU Holdings Ltd./Cayman Islands - Class A	73,382	1,098,527	1.1
Resona Holdings, Inc.	94,738	673,735	0.7
Wells Fargo & Co.	18,548	1,084,506	1.1
		<u>5,703,470</u>	<u>5.8</u>
KAPITALMÄRKTE			
Charles Schwab Corp. (The)	15,882	1,033,926	1.0
London Stock Exchange Group PLC	9,266	1,250,809	1.3
Partners Group Holding AG	499	721,216	0.7
		<u>3,005,951</u>	<u>3.0</u>
FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
Fiserv, Inc.	5,145	898,339	0.9
Visa, Inc. - Class A	5,353	1,479,504	1.5
		<u>2,377,843</u>	<u>2.4</u>
VERSICHERUNGEN			
Aflac, Inc.	11,512	1,270,435	1.3
AIA Group Ltd. - Class H	90,841	639,764	0.6
Intact Financial Corp.	0*	16	0.0
Progressive Corp. (The)	4,225	1,065,443	1.1
Prudential PLC	78,018	671,646	0.7
		<u>3,647,304</u>	<u>3.7</u>
		<u>14,734,568</u>	<u>14.9</u>
GESUNDHEITSWESEN			
GESUNDHEITSWESEN – AUSTRÜSTUNG UND BEDARF			
Alcon, Inc.	10,495	1,022,607	1.0
Becton Dickinson & Co.	3,763	912,155	0.9
GE HealthCare Technologies, Inc.	12,661	1,073,865	1.1
Hologic, Inc.	8,950	727,088	0.7
STERIS PLC	3,996	963,346	1.0
Terumo Corp.	6,139	114,156	0.1
		<u>4,813,217</u>	<u>4.8</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Apollo Hospitals Enterprise Ltd.	11,396	941,506	0.9
Humana, Inc.	2,086	739,348	0.7
Labcorp Holdings, Inc.	3,094	711,374	0.7
UnitedHealth Group, Inc.	1,625	959,206	1.0
		<u>3,351,434</u>	<u>3.3</u>
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Bruker Corp.	11,580	778,063	0.8
ICON PLC	3,534	1,138,152	1.1
IQVIA Holdings, Inc.	2,936	738,424	0.7
		<u>2,654,639</u>	<u>2.6</u>
PHARMAZEUTIKA			
Bristol-Myers Squibb Co.	12,928	645,745	0.6
Roche Holding AG	3,285	1,112,042	1.1
Royalty Pharma PLC - Class A	21,970	637,791	0.6
		<u>2,395,578</u>	<u>2.3</u>
		<u>13,214,868</u>	<u>13.0</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
AUTOMOBILKOMponenten			
Aptiv PLC	12,276	878,126	0.9
BREIT ANGELEGTER EINZELHANDEL			
MercadoLibre, Inc.	377	776,713	0.8
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Entain PLC	44,839	381,981	0.4

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
McDonald's Corp.	3,052	\$ 881,006	0.9%
Viking Holdings Ltd.	19,812	664,682	0.7
		<u>1,927,669</u>	<u>2.0</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Sony Group Corp.	12,046	1,173,169	1.2
TopBuild Corp.	1,072	421,493	0.4
		<u>1,594,662</u>	<u>1.6</u>
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
JD Sports Fashion PLC	354,604	646,354	0.6
Lowe's Cos., Inc.	3,180	790,306	0.8
		<u>1,436,660</u>	<u>1.4</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
On Holding AG - Class A.	16,551	777,547	0.8
		<u>7,391,377</u>	<u>7.5</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Charter Communications, Inc. - Class A.	1,602	556,910	0.6
Comcast Corp. - Class A.	14,917	590,284	0.6
		<u>1,147,194</u>	<u>1.2</u>
UNTERHALTUNG			
Ubisoft Entertainment SA.	20,795	394,045	0.4
Walt Disney Co. (The)	9,473	856,137	0.9
		<u>1,250,182</u>	<u>1.3</u>
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class C.	8,256	1,363,199	1.4
DRAHTLOSE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
T-Mobile US, Inc.	4,177	830,135	0.8
		<u>4,590,710</u>	<u>4.7</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
VERTRIEB UND EINZELHANDEL VON NICHT-ZYKLISCHEN KONSUMGÜTERN			
Dollar Tree, Inc.	7,080	598,150	0.6
Walmart, Inc.	13,773	1,063,686	1.1
		<u>1,661,836</u>	<u>1.7</u>
HAUSHALTSPRODUKTE			
Procter & Gamble Co. (The)	5,440	933,226	0.9
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE			
Unilever PLC.	17,748	1,150,567	1.1
		<u>3,745,629</u>	<u>3.7</u>
ENERGIE			
ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE			
Baker Hughes Co.	15,810	556,054	0.6
Shell PLC.	45,173	1,609,599	1.6
Vallourec SACA.	8,633	137,966	0.1
		<u>2,303,619</u>	<u>2.3</u>
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
Cameco Corp.(a)	21,349	871,902	0.9
Neste Oyj.	16,479	384,531	0.4
		<u>1,256,433</u>	<u>1.3</u>
		<u>3,560,052</u>	<u>3.6</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
LyondellBasell Industries NV - Class A.	9,105	898,672	0.9
BAUMATERIAL			
CRH PLC.	10,548	957,474	1.0
METALL UND BERGBAU			
Anglo American PLC.	4,436	129,395	0.1
Endeavour Mining PLC.	22,906	486,788	0.5
Lundin Mining Corp.	47,854	496,415	0.5
		<u>1,112,598</u>	<u>1.1</u>
		<u>2,968,744</u>	<u>3.0</u>
VERSORGUNG			
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE			
EDP SA.	251,161	1,056,027	1.1
NextEra Energy, Inc.	18,073	1,455,064	1.5
		<u>2,511,091</u>	<u>2.6</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
WASSERVERSORGER					
Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP			2,667	\$ 44,830	0.0%
				<u>2,555,921</u>	<u>2.6</u>
Gesamtanlagen				\$ 97,665,816	97.6%
(Kosten \$82,104,607)					
Termineinlagen					
Barclays, New York(b)	4.68 %	–		715,916	0.7
BNP Paribas, Paris(b)	0.50 %	–		9,699	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	2.27 %	–		353	0.0
Citibank, New York(b)	4.68 %	–		701,311	0.7
DNB, Oslo(b)	2.25 %	–		889	0.0
DNB, Oslo(b)	3.05 %	–		3	0.0
HSBC, Hong Kong(b)	1.71 %	–		26,174	0.0
HSBC, London(b)	3.90 %	–		10,018	0.0
MUFG, Tokyo(b)	0.01 %	–		4,949	0.0
Nordea, Oslo(b)	3.26 %	–		4,982	0.0
Scotiabank, Toronto(b)	3.30 %	–		191,253	0.2
SMBC, London(b)	0.01 %	–		4,906	0.0
SMBC, Tokyo(b)	2.62 %	–		<u>305,232</u>	<u>0.3</u>
Termineinlagen insgesamt				<u>1,975,685</u>	<u>1.9</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>463,455</u>	<u>0.5</u>
Nettovermögen				<u>\$ 100,104,956</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Bank of America NA	USD 324	SEK 3,411	09/19/2024	\$ 8,177
Bank of America NA	CHF 267	USD 319	10/25/2024	3,034
Bank of America NA	CHF 246	USD 291	10/25/2024	(132)
Bank of America NA	USD 2,114	EUR 1,928	10/25/2024	22,233
Bank of America NA	USD 658	CAD 892	11/07/2024	5,088
Bank of America NA	GBP 2,501	USD 3,312	11/08/2024	25,717
Bank of America NA	TWD 37,961	USD 1,193	11/22/2024	(6,006)
Barclays Bank PLC	USD 822	BRL 4,555	09/04/2024	(13,997)
Barclays Bank PLC	USD 66	INR 5,565	09/13/2024	(122)
Barclays Bank PLC	NOK 1,363	USD 125	09/19/2024	(3,457)
Barclays Bank PLC	BRL 4,555	USD 820	10/02/2024	14,109
Barclays Bank PLC	CHF 411	USD 489	10/25/2024	1,759
BNP Paribas SA	USD 142	ZAR 2,548	10/17/2024	70
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 3	USD 4	09/23/2024	30
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 5,053	EUR 4,547	09/23/2024	(22,548)
Citibank NA	USD 66	INR 5,565	09/13/2024	(106)
Citibank NA	CNH 5,025	USD 693	09/27/2024	(17,578)
Citibank NA	USD 1,294	CNH 9,376	09/27/2024	32,801
Citibank NA	USD 56	CNH 393	09/27/2024	(126)
Citibank NA	TWD 10,992	USD 345	11/22/2024	(1,904)
Deutsche Bank AG	USD 1,165	EUR 1,048	10/25/2024	(3,995)
Goldman Sachs Bank USA	CHF 466	USD 551	10/25/2024	(135)
HSBC Bank USA	USD 134	KRW 183,565	10/18/2024	3,850
JPMorgan Chase Bank NA	BRL 3,810	USD 671	09/04/2024	(4,534)
JPMorgan Chase Bank NA	USD 1,446	JPY 211,047	10/17/2024	7,165
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 852	AUD 1,281	09/19/2024	15,052
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 123	MXN 2,237	09/26/2024	(9,565)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 652	CNH 4,632	09/27/2024	3,594
Morgan Stanley Capital Services LLC	KRW 679,161	USD 511	10/18/2024	1,522
Morgan Stanley Capital Services LLC	KRW 3,049,313	USD 2,226	10/18/2024	(59,607)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 875	KRW 1,194,911	10/18/2024	20,999
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 141	SGD 189	10/18/2024	4,232
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR 147	USD 161	10/25/2024	(1,836)
Morgan Stanley Capital Services LLC	GBP 100	USD 132	11/08/2024	504
Standard Chartered Bank	BRL 744	USD 136	09/04/2024	3,709
Standard Chartered Bank	USD 152	KRW 208,538	10/18/2024	4,670
State Street Bank & Trust Co.	HKD 3,769	USD 484	10/17/2024	(406)
UBS AG	NOK 3,716	USD 346	09/19/2024	(3,926)
				<u>\$ 28,335</u>
			Wertsteigerung	\$ 178,315
			Wertminderung	\$ (149,980)

+ Zur Absicherung des Portfolios oder der Anteilklassen.

* Anteilsbetrag weniger als 0.50.

(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

INR – Indian Rupee

JPY – Japanese Yen

KRW – South Korean Won

MXN – Mexican Peso

NOK – Norwegian Krone

SEK – Swedish Krona

SGD – Singapore Dollar

TWD – New Taiwan Dollar

USD – United States Dollar

ZAR – South African Rand

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Sinbon Electronics Co., Ltd.	934,000	\$ 8,683,586	1.6%
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
FPT Corp.	264,342	1,435,108	0.3
Globant SA(a)	38,474	7,780,982	1.4
Tata Consultancy Services Ltd.	171,221	9,320,006	1.7
		<u>18,536,096</u>	<u>3.4</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
ASPEED Technology, Inc.	11,100	1,712,441	0.3
Broadcom, Inc.	113,639	18,502,702	3.4
MediaTek, Inc.	409,000	15,876,090	2.9
Realtek Semiconductor Corp.	458,000	7,670,640	1.4
SK Hynix, Inc.	146,436	19,189,229	3.5
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	1,576,000	46,658,070	8.6
		<u>109,609,172</u>	<u>20.1</u>
SOFTWARE			
TOTVS SA.	908,300	4,830,020	0.9
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Samsung Electronics Co., Ltd.	444,803	24,703,612	4.5
Samsung Electronics Co., Ltd. (Preference Shares)	117,113	5,262,041	1.0
		<u>29,965,653</u>	<u>5.5</u>
		<u>171,624,527</u>	<u>31.5</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Al Rajhi Bank	480,336	11,311,311	2.1
Bank Central Asia Tbk PT	13,636,000	9,109,783	1.7
Bank for Foreign Trade of Vietnam JSC	1,460,673	5,390,025	1.0
Bank Mandiri Persero Tbk PT	23,647,500	10,927,419	2.0
HDFC Bank Ltd.	839,428	16,304,620	3.0
ICICI Bank Ltd.	383,070	5,637,209	1.0
Itau Unibanco Holding SA (Preference Shares)	1,319,100	8,589,673	1.6
NU Holdings Ltd./Cayman Islands - Class A	853,480	12,776,596	2.4
		<u>80,046,636</u>	<u>14.8</u>
KAPITALMÄRKTE			
HDFC Asset Management Co., Ltd.	281,584	14,859,769	2.7
FINANZWESEN – VERBRAUCHER			
Kaspi.KZ JSC (ADR)	49,345	6,460,741	1.2
VERSICHERUNGEN			
AIA Group Ltd. - Class H	772,600	5,441,178	1.0
Bupa Arabia for Cooperative Insurance Co.	76,385	4,730,553	0.9
PICC Property & Casualty Co., Ltd. - Class H	3,016,000	3,906,009	0.7
		<u>14,077,740</u>	<u>2.6</u>
		<u>115,444,886</u>	<u>21.3</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
BREIT ANGELEGTER EINZELHANDEL			
JD.com, Inc. - Class H	424,750	5,740,978	1.1
MercadoLibre, Inc.	4,611	9,506,314	1.8
PDD Holdings, Inc. (ADR)	120,534	11,584,523	2.1
		<u>26,831,815</u>	<u>5.0</u>
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
New Oriental Education & Technology Group, Inc. - Class H	1,859,800	11,317,230	2.1
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
MakeMyTrip Ltd.	56,950	5,476,881	1.0
Trip.com Group Ltd. - Class H	100,200	4,719,720	0.9
		<u>10,196,601</u>	<u>1.9</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
ANTA Sports Products Ltd. - Class H	746,200	7,280,061	1.3
Bosideng International Holdings Ltd. - Class H	13,090,000	6,429,339	1.2
		<u>13,709,400</u>	<u>2.5</u>
		<u>62,055,046</u>	<u>11.5</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
UNTERHALTUNG			
International Games System Co., Ltd.	208,000	5,074,712	0.9
NetEase, Inc. - Class H	468,200	7,526,141	1.4
		<u>12,600,853</u>	<u>2.3</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Kanzhun Ltd. (ADR)	643,200	\$ 8,014,272	1.5%
Tencent Holdings Ltd. - Class H	675,400	<u>32,756,840</u>	<u>6.0</u>
		<u>40,771,112</u>	<u>7.5</u>
		<u>53,371,965</u>	<u>9.8</u>
INDUSTRIEGÜTER			
BAU- UND INGENIEURWESEN			
Larsen & Toubro Ltd.	179,567	<u>7,942,371</u>	<u>1.5</u>
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Riyadh Cables Group Co.	197,054	<u>5,861,863</u>	<u>1.1</u>
MASCHINEN			
Yutong Bus Co., Ltd. - Class A	2,392,800	<u>7,191,896</u>	<u>1.3</u>
TRANSPORTWESEN – INFRASTRUKTUR			
International Container Terminal Services, Inc.	1,141,560	<u>8,054,961</u>	<u>1.5</u>
		<u>29,051,091</u>	<u>5.4</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Kweichow Moutai Co., Ltd. - Class A	27,192	<u>5,519,921</u>	<u>1.0</u>
VERTRIEB UND EINZELHANDEL VON NICHT-ZYKLISCHEN KONSUMGÜTERN			
BBB Foods, Inc. - Class A	254,113	8,075,711	1.5
BIM Birlesik Magazalar AS.	215,290	<u>3,409,733</u>	<u>0.6</u>
		<u>11,485,444</u>	<u>2.1</u>
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Saudia Dairy & Foodstuff Co.	27,721	<u>2,613,687</u>	<u>0.5</u>
TABAK			
ITC Ltd.	1,375,500	<u>8,246,970</u>	<u>1.5</u>
		<u>27,866,022</u>	<u>5.1</u>
VERSORGUNG			
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE			
Equatorial Energia SA	1,332,200	<u>8,084,039</u>	<u>1.5</u>
UNABHÄNGIGE STROM- UND ERNEUERBARE ELEKTRIZITÄTSPRODUZENTEN			
NTPC Ltd.	1,971,171	<u>9,799,536</u>	<u>1.8</u>
WASSERVERSORGER			
Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP	261,349	<u>4,392,798</u>	<u>0.8</u>
		<u>22,276,373</u>	<u>4.1</u>
GESUNDHEITSWESEN			
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Max Healthcare Institute Ltd.	493,966	<u>5,084,591</u>	<u>0.9</u>
PHARMAZEUTIKA			
Sun Pharmaceutical Industries Ltd.	412,474	<u>8,969,646</u>	<u>1.7</u>
		<u>14,054,237</u>	<u>2.6</u>
IMMOBILIEN			
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG			
Macrotech Developers Ltd.	827,670	<u>12,312,532</u>	<u>2.3</u>
GRUNDSTOFFE			
METALL UND BERGBAU			
Freeport-McMoRan, Inc.	122,760	<u>5,435,813</u>	<u>1.0</u>
ENERGIE			
ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE			
Ades Holding Co.	764,690	<u>4,173,333</u>	<u>0.8</u>
		<u>517,665,825</u>	<u>95.4</u>
AKTIENANLEIHEN			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
FPT Corp., expiring 03/13/2025	2,518,557	<u>13,656,535</u>	<u>2.5</u>
BEZUGSRECHTE			
VERSORGUNG			
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE			
Equatorial Energia SA, expiring 09/20/2024	87,761	<u>29,586</u>	<u>0.0</u>
		<u>531,351,946</u>	<u>97.9</u>
Gesamtanlagen			
(Kosten \$433,942,911)		<u>\$ 531,351,946</u>	<u>97.9%</u>

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Termineinlagen				
BNP Paribas, Paris(b)	0.50 %	–	\$ 8,910	0.0%
BNP Paribas, Paris(b)	1.71 %	–	55,482	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	3.30 %	–	114	0.0
DNB, Oslo(b)	2.25 %	–	92	0.0
DNB, Oslo(b)	3.05 %	–	4,482	0.0
HSBC, Singapore(b)	2.11 %	–	55,133	0.0
SMBC, London(b)	0.01 %	–	2,726	0.0
SMBC, London(b)	3.90 %	–	9,549	0.0
SMBC, London(b)	4.68 %	–	9,851,262	1.8
SMBC, Tokyo(b)	2.62 %	–	3,065	0.0
Standard Chartered Bank, Johannesburg(b)	6.46 %	–	11,361	0.0
Termineinlagen insgesamt			<u>10,002,176</u>	<u>1.8</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			<u>1,560,713</u>	<u>0.3</u>
Nettovermögen			<u>\$ 542,914,835</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 57	USD 39	09/23/2024	\$ 127
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 174	USD 117	09/23/2024	(335)
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 272	USD 71	09/23/2024	684
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 55	USD 14	09/23/2024	(4)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 1	USD 1	09/23/2024	1
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,453	AUD 3,638	09/23/2024	10,461
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1	AUD 2	09/23/2024	(4)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 963	PLN 3,705	09/23/2024	(7,212)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 27	SGD 36	09/23/2024	21
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 0*	SGD 0*	09/23/2024	(0)**
				<u>\$ 3,739</u>
			Wertsteigerung \$	11,294
			Wertminderung \$	(7,555)

+ Zur Absicherung des Portfolios oder der Anteilklassen.

* Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

** Betrag weniger als 0.50.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar

PLN – Polish Zloty

SGD – Singapore Dollar

USD – United States Dollar

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt

JSC – Joint Stock Company

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Hon Hai Precision Industry Co., Ltd.	1,766,000	\$ 10,185,277	2.7%
Tripod Technology Corp.	524,000	3,382,495	0.9
Unimicron Technology Corp.	1,126,000	5,754,955	1.5
		<u>19,322,727</u>	<u>5.1</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
FPT Corp.	2,216,194	12,011,940	3.1
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
King Yuan Electronics Co., Ltd.	2,328,000	8,805,502	2.3
MediaTek, Inc.	204,000	7,907,471	2.1
SK Hynix, Inc.	120,330	15,646,458	4.1
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	1,125,000	33,197,874	8.7
		<u>65,557,305</u>	<u>17.2</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Quanta Computer, Inc.	541,000	4,532,291	1.2
Samsung Electronics Co., Ltd.	327,120	18,194,420	4.8
		<u>22,726,711</u>	<u>6.0</u>
		<u>119,618,683</u>	<u>31.4</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	26,092,900	9,032,482	2.4
BDO Unibank, Inc.	612,520	1,666,840	0.4
China Merchants Bank Co., Ltd. - Class H	2,169,000	8,998,326	2.4
CIMB Group Holdings Bhd.	2,261,500	4,290,179	1.1
City Union Bank Ltd.	1,161,277	2,367,657	0.6
Hana Financial Group, Inc.	154,870	7,176,295	1.9
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. - Class H	12,037,000	6,930,946	1.8
KB Financial Group, Inc.	267,870	17,225,013	4.5
Metropolitan Bank & Trust Co.	3,029,290	3,965,322	1.0
Shanghai Pudong Development Bank Co., Ltd. - Class A	7,620,700	9,062,599	2.4
State Bank of India.	203,275	1,978,672	0.5
		<u>72,694,331</u>	<u>19.0</u>
FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
L&T Finance Ltd.	1,973,310	3,996,205	1.0
VERSICHERUNGEN			
DB Insurance Co., Ltd.	64,180	5,573,141	1.5
PICC Property & Casualty Co., Ltd. - Class H	3,560,000	4,611,044	1.2
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class A	678,100	4,211,849	1.1
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	1,293,000	6,201,518	1.6
Samsung Fire & Marine Insurance Co., Ltd.	16,560	4,295,422	1.1
Samsung Life Insurance Co., Ltd.	59,730	4,346,114	1.1
		<u>29,239,088</u>	<u>7.6</u>
		<u>105,929,624</u>	<u>27.6</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KRAFTFAHRZEUGE			
BYD Co., Ltd. - Class H	131,000	4,052,066	1.1
Hyundai Motor Co.	41,280	7,895,377	2.1
Kia Corp.	50,000	3,971,254	1.0
		<u>15,918,697</u>	<u>4.2</u>
BREIT ANGELEGTER EINZELHANDEL			
Alibaba Group Holding Ltd. - Class H	485,100	5,066,993	1.3
PDD Holdings, Inc. (ADR)	74,170	7,128,479	1.9
		<u>12,195,472</u>	<u>3.2</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai - Class A	962,808	5,392,132	1.4
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Bosideng International Holdings Ltd. - Class H	10,688,000	5,249,563	1.4
Zhejiang Semir Garment Co., Ltd. - Class A	373,128	238,444	0.1
		<u>5,488,007</u>	<u>1.5</u>
		<u>38,994,308</u>	<u>10.3</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Kumho Petrochemical Co., Ltd.	34,890	3,575,582	0.9
UPL Ltd.	713,393	5,088,601	1.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Yunnan Yuntianhua Co., Ltd. - Class A			2,082,700	\$ 6,064,106	1.6%
				<u>14,728,289</u>	<u>3.8</u>
METALL UND BERGBAU					
Shandong Nanshan Aluminum Co., Ltd. - Class A			14,113,800	7,307,021	1.9
Zijin Mining Group Co., Ltd. - Class H			3,586,000	7,275,196	1.9
				<u>14,582,217</u>	<u>3.8</u>
				<u>29,310,506</u>	<u>7.6</u>
VERSORGUNG					
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE					
Power Grid Corp. of India Ltd.			1,306,918	5,284,002	1.4
GASVERSORGUNGSBETRIEBE					
GAIL India Ltd.			4,534,123	12,790,718	3.3
Kunlun Energy Co., Ltd. - Class H			9,229,000	9,243,439	2.4
				<u>22,034,157</u>	<u>5.7</u>
				<u>27,318,159</u>	<u>7.1</u>
INDUSTRIEGÜTER					
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG					
Henan Pinggao Electric Co., Ltd. - Class A			1,385,100	3,591,344	0.9
INDUSTRIEKONZERNE					
SK Square Co., Ltd.			93,030	5,466,823	1.4
MASCHINEN					
Yutong Bus Co., Ltd. - Class A			617,300	1,857,451	0.5
Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co., Ltd. - Class A			2,059,000	1,835,709	0.5
				<u>3,693,160</u>	<u>1.0</u>
TRANSPORTWESEN – INFRASTRUKTUR					
Shandong Hi-speed Co., Ltd. - Class A			2,052,200	2,628,669	0.7
TangShan Port Group Co., Ltd. - Class A			5,172,403	3,611,835	0.9
				<u>6,240,504</u>	<u>1.6</u>
				<u>18,991,831</u>	<u>4.9</u>
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
PetroChina Co., Ltd. - Class H			12,950,000	11,741,324	3.1
Thai Oil PCL			2,311,000	3,618,939	0.9
				<u>15,360,263</u>	<u>4.0</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
UNTERHALTUNG					
International Games System Co., Ltd.			86,000	2,094,217	0.6
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN					
Tencent Holdings Ltd. - Class H			191,500	9,381,236	2.5
				<u>11,475,453</u>	<u>3.1</u>
IMMOBILIEN					
REITs – INDUSTRIE					
CapitalLand Ascendas REIT			1,596,800	3,524,107	0.9
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG					
Ayala Land, Inc.			11,505,300	7,233,074	1.9
				<u>10,757,181</u>	<u>2.8</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$327,632,210).				\$ 377,756,008	98.8%
Termineinlagen					
ANZ, Hong Kong(a)	3.44 %	–		114	0.0
BNP Paribas, Paris(a)	1.71 %	–		518,996	0.1
DNB, Oslo(a)	3.05 %	–		201	0.0
HSBC, Singapore(a)	2.11 %	–		341	0.0
Scotiabank, Toronto(a)	3.30 %	–		6	0.0
SMBC, London(a)	3.90 %	–		34	0.0
SMBC, London(a)	4.68 %	–		3,086,061	0.8
SMBC, Tokyo(a)	2.62 %	–		68	0.0
Standard Chartered Bank, Johannesburg(a)	6.46 %	–		6,792	0.0
Termineinlagen insgesamt.				<u>3,612,613</u>	<u>0.9</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten.				<u>1,046,912</u>	<u>0.3</u>
Nettovermögen				<u>\$ 382,415,533</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	AUD	419	USD	285	09/23/2024	\$ 796
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	AUD	198	USD	134	09/23/2024	(407)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CAD	61	USD	45	09/23/2024	66
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR	5	USD	6	09/23/2024	38
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	GBP	35	USD	46	09/23/2024	245
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	NZD	59	USD	37	09/23/2024	30
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	NZD	78	USD	49	09/23/2024	(65)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD	1	USD	1	09/23/2024	1
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	20,127	AUD	29,847	09/23/2024	85,583
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	18	AUD	26	09/23/2024	(58)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	3,655	CAD	4,979	09/23/2024	41,292
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	452	EUR	406	09/23/2024	(2,009)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	3,744	GBP	2,874	09/23/2024	31,013
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	0*	GBP	0*	09/23/2024	(2)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	3,928	NZD	6,388	09/23/2024	65,552
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	55	SGD	72	09/23/2024	41
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	1	SGD	1	09/23/2024	(0)**
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	9,151	ZAR	163,682	09/23/2024	15,148
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	1	ZAR	14	09/23/2024	(4)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR	2,298	USD	129	09/23/2024	527
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR	997	USD	55	09/23/2024	(473)
						\$ 237,314
					Wertsteigerung	\$ 240,332
					Wertminderung	\$ (3,018)

+ Zur Absicherung des Portfolios oder der Anteilklassen.

* Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

** Betrag weniger als 0.50.

(a) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
CAD – Canadian Dollar
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
REIT – Real Estate Investment Trust

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (JPY)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INDUSTRIEGÜTER			
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Park24 Co., Ltd.	101,900	¥ 177,255,050	2.1%
BAU- UND INGENIEURWESEN			
Kumagai Gumi Co., Ltd.	30,500	109,190,000	1.3
Shimizu Corp.(a)	99,500	96,873,200	1.2
		<u>206,063,200</u>	<u>2.5</u>
TRANSPORT AUF DEM LANDWEG			
East Japan Railway Co.	42,500	119,063,750	1.4
INDUSTRIEKONZERNE			
Hitachi Ltd.	86,400	308,620,800	3.7
MASCHINEN			
Fuji Corp./Aichi.	40,700	99,308,000	1.2
IHI Corp.(a)	34,600	219,294,800	2.7
Makino Milling Machine Co., Ltd.	21,500	125,560,000	1.5
Toyota Industries Corp.	12,100	138,424,000	1.7
		<u>582,586,800</u>	<u>7.1</u>
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
dip Corp.(a)	38,300	110,610,400	1.3
UT Group Co., Ltd.	60,300	170,528,400	2.1
		<u>281,138,800</u>	<u>3.4</u>
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
Mitsubishi Corp.	125,500	378,131,500	4.6
		<u>2,052,859,900</u>	<u>24.8</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KRAFTFAHRZEUGE			
Honda Motor Co., Ltd.	178,600	283,616,800	3.4
Subaru Corp.	45,400	125,326,700	1.5
Toyota Motor Corp.	43,500	120,038,250	1.5
		<u>528,981,750</u>	<u>6.4</u>
BREIT ANGELEGTER EINZELHANDEL			
ASKUL Corp.	59,900	126,988,000	1.5
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Food & Life Cos. Ltd.	47,300	128,230,300	1.6
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Sony Group Corp.	27,900	396,180,000	4.8
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Shimamura Co., Ltd.	13,200	102,696,000	1.2
		<u>1,283,076,050</u>	<u>15.5</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	131,800	201,390,400	2.4
Resona Holdings, Inc.	310,700	320,176,350	3.9
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	47,300	451,715,000	5.5
		<u>973,281,750</u>	<u>11.8</u>
FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
ORIX Corp.	40,700	148,310,800	1.8
		<u>1,121,592,550</u>	<u>13.6</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Ok Electric Industry Co., Ltd.	118,000	120,006,000	1.5
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
BIPROGY, Inc.	43,300	203,899,700	2.5
NEC Networks & System Integration Corp.	67,900	178,848,600	2.2
		<u>382,748,300</u>	<u>4.7</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
SCREEN Holdings Co., Ltd.	6,000	65,370,000	0.8
Tokyo Electron Ltd.	10,950	282,564,750	3.4
		<u>347,934,750</u>	<u>4.2</u>
		<u>850,689,050</u>	<u>10.4</u>
KOMMUNIKATIONS-DIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONS-DIENSTE			
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	1,440,200	224,239,140	2.7

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (JPY)	Nettover- mögen %
UNTERHALTUNG					
Konami Group Corp.			23,400	¥ 307,593,000	3.7%
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN					
Kakaku.com, Inc.			82,600	206,582,600	2.5
MEDIEN					
Kadokawa Corp.			38,600	112,229,500	1.4
				850,644,240	10.3
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
Air Water, Inc.			57,100	116,227,050	1.4
Kuraray Co., Ltd.			27,000	51,570,000	0.6
Tosoh Corp.			67,100	125,812,500	1.5
Zeon Corp.			106,700	128,200,050	1.5
				421,809,600	5.0
CONTAINER UND VERPACKUNGEN					
Rengo Co., Ltd.			166,900	167,651,050	2.0
METALL UND BERGBAU					
Osaka Titanium Technologies Co., Ltd.(a)			43,000	110,897,000	1.3
Sumitomo Metal Mining Co., Ltd.			15,000	61,260,000	0.7
Toho Titanium Co., Ltd.(a)			62,400	75,254,400	0.9
				247,411,400	2.9
				836,872,050	9.9
VERBRAUCHSGÜTER					
GETRÄNKE					
Asahi Group Holdings Ltd.			32,536	176,572,872	2.1
VERTRIEB UND EINZELHANDEL VON NICHT-ZYKLISCHEN KONSUMGÜTERN					
Sundrug Co., Ltd.			28,700	121,688,000	1.5
LEBENSMITTELPRODUKTE					
Nichirei Corp.			29,500	129,092,000	1.6
				427,352,872	5.2
IMMOBILIEN					
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG					
Katitas Co., Ltd.			45,600	85,636,800	1.0
Mitsui Fudosan Co., Ltd.			202,200	317,049,600	3.8
				402,686,400	4.8
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
ENEOS Holdings, Inc.			295,900	233,613,050	2.8
GESUNDHEITSWESEN					
PHARMAZEUTIKA					
Santen Pharmaceutical Co., Ltd.(a)			64,300	120,658,950	1.5
Gesamtanlagen				¥ 8,180,045,112	98.8%
(Kosten ¥7,149,526,356)					
Termineinlagen					
ANZ, Hong Kong(b)	3.44 %	–		25,885	0.0
DNB, Oslo(b)	3.05 %	–		38,275	0.0
HSBC, Paris(b)	2.62 %	–		1,896	0.0
HSBC, Singapore(b)	2.11 %	–		710	0.0
SMBC, London(b)	0.01 %	–		122,293,488	1.5
SMBC, Tokyo(b)	4.68 %	–		3,111,239	0.0
Standard Chartered Bank, Johannesburg(b)	6.46 %	–		203,470	0.0
Termineinlagen insgesamt				125,674,963	1.5
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				(28,569,648)	(0.3)
Nettovermögen				¥ 8,277,150,427	100.0%

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 38,651	ZAR 4,764	09/20/2024	¥ 268,924
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 106	JPY 856	09/20/2024	(8,959)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 49	JPY 4,803	09/24/2024	(54,976)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CZK 6	JPY 40	09/24/2024	(227)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 38	JPY 6,167	09/24/2024	(5,926)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 352,259	AUD 3,599	09/24/2024	2,942,227
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 3,801	CZK 593	09/24/2024	17,617
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 41	CZK 6	09/24/2024	(23)

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	555	EUR	3	09/24/2024	¥ 2,531
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	408,337	EUR	2,531	09/24/2024	(135,848)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	8,648	NZD	97	09/24/2024	185,299
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	10,501	SGD	94	09/24/2024	58,978
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	896,573	USD	6,164	09/24/2024	1,959,521
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	NZD	1	JPY	90	09/24/2024	(2,209)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD	2	JPY	192	09/24/2024	(1,413)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	367	JPY	53,259	09/24/2024	(241,357)
						¥ 4,984,159
					Wertsteigerung	¥ 5,435,097
					Wertminderung	¥ (450,938)

+ Zur Absicherung des Portfolios oder der Anteilklassen.

(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 Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
ÖSTERREICH					
Republic of Austria Government Bond	6.25%	07/15/2027	EUR 9,002	\$ 10,978,218	2.4%
KOLUMBIEN					
Colombian TES, Series B	5.75%	11/03/2027	COP 32,064,500	6,992,626	1.5
FINNLAND					
Finland Government Bond	2.50%	04/15/2030	EUR 5,015	5,529,350	1.2
FRANKREICH					
French Republic Government Bond OAT, Series OAT	2.75%	02/25/2029	2,327	2,583,369	0.6
INDONESIEN					
Indonesia Treasury Bond, Series 101	6.88%	04/15/2029	IDR 20,075,000	1,316,163	0.3
ITALIEN					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series 3Y	2.95%	02/15/2027	EUR 8,485	9,407,007	2.1
JAPAN					
Japan Government Twenty Year Bond, Series 72	2.10%	09/20/2024	JPY 1,600,000	10,955,258	2.4
Japan Government Twenty Year Bond, Series 76	1.90%	03/20/2025	2,654,400	18,323,491	4.0
Japan Government Twenty Year Bond, Series 82	2.10%	09/20/2025	931,100	6,491,318	1.4
Japan Government Twenty Year Bond, Series 88	2.30%	06/20/2026	2,624,500	18,581,854	4.1
				54,351,921	11.9
MALAYSIA					
Malaysia Government Bond, Series 0219	3.89%	08/15/2029	MYR 4,296	1,010,089	0.2
Malaysia Government Bond, Series 0417	3.90%	11/16/2027	6,482	1,521,714	0.3
				2,531,803	0.5
SPANIEN					
Spain Government Bond	2.50%	05/31/2027	EUR 8,407	9,268,672	2.1
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Notes	4.00%	01/15/2027	USD 12,387	12,423,674	2.7
U.S. Treasury Notes	4.38%	10/31/2024	20,833	20,803,705	4.6
U.S. Treasury Notes	4.50%	07/15/2026	18,317	18,488,318	4.1
U.S. Treasury Notes	4.63%	03/15/2026	18,217	18,359,220	4.1
U.S. Treasury Notes	4.63%	11/15/2026	40,077	40,684,009	9.0
U.S. Treasury Notes	4.88%	04/30/2026	2,113	2,140,302	0.5
U.S. Treasury Notes	5.00%	10/31/2025	36,360	36,638,480	8.1
				149,537,708	33.1
				252,496,837	55.7
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
ABN AMRO Bank NV	1.54%	06/16/2027	500	471,227	0.1
ABN AMRO Bank NV(a)	7.15%	09/18/2027	900	912,236	0.2
AIB Group PLC	7.58%	10/14/2026	973	999,738	0.2
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series G	4.13%	05/10/2026	EUR 1,300	1,442,215	0.3
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4.94%	01/26/2026	USD 1,444	1,449,974	0.3
Banque Federative du Credit Mutuel SA(a)	6.50%	01/23/2027	550	553,184	0.1
Barclays PLC	5.67%	03/12/2028	414	422,717	0.1
Barclays PLC, Series E	2.89%	01/31/2027	EUR 1,008	1,108,652	0.3
Citigroup, Inc.(a)	6.90%	03/17/2026	USD 549	551,556	0.1
Credit Agricole SA(a)	6.24%	03/11/2027	1,824	1,826,817	0.4
Danske Bank A/S	0.98%	09/10/2025	1,009	1,008,062	0.2
DNB Bank ASA, Series E	4.00%	08/17/2027	GBP 1,455	1,874,165	0.4
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	4.39%	06/15/2027	USD 906	901,561	0.2
ING Groep NV, Series G	1.25%	02/16/2027	EUR 1,700	1,822,664	0.4
Intesa Sanpaolo SpA, Series E	4.50%	10/02/2025	1,464	1,634,555	0.4
JPMorgan Chase & Co.	0.99%	04/28/2026	GBP 1,191	1,521,876	0.3
KBC Group NV, Series E	4.50%	06/06/2026	EUR 1,400	1,556,456	0.3
Lloyds Banking Group PLC(a)	6.95%	01/05/2028	USD 1,360	1,376,373	0.3
Morgan Stanley, Series G	1.88%	04/27/2027	EUR 1,683	1,802,049	0.4
NatWest Markets PLC, Series E	6.63%	06/22/2026	GBP 1,047	1,416,719	0.3
Nordea Bank Abp, Series E	6.00%	06/02/2026	1,220	1,611,070	0.4
Santander UK Group Holdings PLC, Series E	2.92%	05/08/2026	1,177	1,521,560	0.3
Societe Generale SA	0.88%	09/22/2028	EUR 700	712,375	0.2
Standard Chartered PLC	2.82%	01/30/2026	USD 1,576	1,558,907	0.3
Standard Chartered PLC	6.17%	01/09/2027	257	260,917	0.1
Swedbank AB, Series E	3.75%	11/14/2025	EUR 1,764	1,961,593	0.4
UBS Group AG, Series E	1.00%	06/24/2027	1,718	1,819,700	0.4
Virgin Money UK PLC	4.00%	03/18/2028	159	177,829	0.0
				34,276,747	7.4

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
MAKLER						
	Charles Schwab Corp. (The)(a)	5.89%	05/13/2026	USD 1,763	\$ 1,755,715	0.4%
	Nomura Holdings, Inc.	5.71%	01/09/2026	1,521	1,535,369	0.3
					3,291,084	0.7
FINANZEN						
	Aviation Capital Group LLC	5.50%	12/15/2024	747	745,119	0.2
VERSICHERUNGEN						
	Athene Global Funding	5.15%	07/28/2027	GBP 1,000	1,312,582	0.3
	Berkshire Hathaway, Inc.	0.00%	03/12/2025	EUR 2,171	2,354,641	0.5
	Metropolitan Life Global Funding I, Series E	1.75%	05/25/2025	1,945	2,124,034	0.5
	New York Life Global Funding(a)	5.85%	06/09/2026	USD 2,083	2,086,068	0.5
					7,877,325	1.8
					46,190,275	10.1
INDUSTRIE						
INVESTITIONSGÜTER						
	Parker-Hannifin Corp.	1.13%	03/01/2025	EUR 1,421	1,550,487	0.3
KOMMUNIKATIONSMEDIEN						
	Comcast Corp.	0.00%	09/14/2026	1,774	1,844,332	0.4
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION						
	AT&T, Inc.	0.25%	03/04/2026	626	663,790	0.2
	AT&T, Inc.	3.55%	11/18/2025	745	825,755	0.2
	CK Hutchison Group Telecom Finance SA	0.75%	04/17/2026	1,566	1,656,475	0.4
	Verizon Communications, Inc.	4.13%	03/16/2027	USD 1,358	1,347,187	0.3
					4,493,207	1.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ						
	Ford Motor Credit Co. LLC	5.80%	03/05/2027	1,335	1,355,222	0.3
	Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.35%	06/08/2025	1,409	1,384,843	0.3
	Hyundai Capital America	5.95%	09/21/2026	1,600	1,636,352	0.4
	Toyota Credit Canada, Inc.	5.29%	07/13/2026	CAD 1,044	791,378	0.2
	Toyota Finance Australia Ltd., Series E	3.43%	06/18/2026	EUR 872	969,886	0.2
					6,137,681	1.4
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS						
	McDonald's Corp., Series G	3.63%	11/28/2027	556	625,481	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER						
	VF Corp., Series E	4.13%	03/07/2026	542	599,077	0.1
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
	Abbott Ireland Financing DAC, Series EUR	1.50%	09/27/2026	1,878	2,018,422	0.5
	American Medical Systems Europe BV	0.75%	03/08/2025	1,249	1,359,976	0.3
	AstraZeneca PLC, Series E	3.63%	03/03/2027	606	679,621	0.2
	Becton Dickinson & Co.	0.03%	08/13/2025	551	589,451	0.1
	DH Europe Finance II SARL	0.20%	03/18/2026	1,783	1,886,570	0.4
	Haleon Netherlands Capital BV, Series E	1.25%	03/29/2026	353	378,917	0.1
	Keurig Dr. Pepper, Inc.(a)	6.25%	03/15/2027	USD 1,367	1,372,835	0.3
	Kroger Co. (The)	4.60%	08/15/2027	339	339,908	0.1
					8,625,700	2.0
ENERGIE						
	BP Capital Markets PLC, Series E	2.21%	09/25/2026	EUR 1,655	1,803,182	0.4
TECHNOLOGIE						
	Honeywell International, Inc., Series 4Y	3.50%	05/17/2027	1,580	1,764,066	0.4
					27,443,213	6.2
VERSORGUNGSBETRIEBE						
ELEKTRIZITÄT						
	Enel Finance International NV	6.80%	10/14/2025	USD 1,428	1,461,133	0.3
	Southern Co. (The)	5.15%	10/06/2025	893	896,396	0.2
					2,357,529	0.5
ERDGAS						
	National Grid North America, Inc., Series E	0.41%	01/20/2026	EUR 1,301	1,382,402	0.3
					3,739,931	0.8
					77,373,419	17.1
INFLATIONSgebundene Wertpapiere						
KANADA						
	Canadian Government Real Return Bond	4.25%	12/01/2026	CAD 2,137	1,682,042	0.4
SCHWEDEN						
	Sweden Inflation Linked Bond, Series 3104	3.50%	12/01/2028	SEK 3,280	579,061	0.1
	Sweden Inflation Linked Bond, Series 3112	0.13%	06/01/2026	1,775	224,402	0.1
	Sweden Inflation Linked Bond, Series 3113	0.13%	12/01/2027	11,935	1,481,607	0.3
					2,285,070	0.5

AB FCPI
Short Duration Bond Portfolio

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Inflation Index.	0.13%	04/15/2026	USD 9,860	\$ 9,507,909	2.1%
U.S. Treasury Inflation Index.	0.13%	04/15/2027	9,436	8,999,538	2.0
				<u>18,507,447</u>	<u>4.1</u>
				<u>22,474,559</u>	<u>5.0</u>
GEDECKTE ANLEIHEN					
Banco de Sabadell SA, Series DMTN.	3.50%	08/28/2026	EUR 1,200	1,341,148	0.3
BPCE SFH SA.	3.13%	01/24/2028	2,100	2,347,530	0.5
Credit Agricole Home Loan SFH SA.	2.75%	01/12/2028	1,900	2,099,378	0.5
Korea Housing Finance Corp.	3.71%	04/11/2027	1,416	1,596,037	0.3
Lloyds Bank PLC, Series E.	0.13%	06/18/2026	1,641	1,726,339	0.4
National Australia Bank Ltd., Series E.	0.88%	02/19/2027	1,361	1,433,907	0.3
National Australia Bank Ltd., Series G.	0.63%	03/16/2027	899	940,436	0.2
Santander UK PLC.	1.13%	03/12/2027	2,116	2,242,189	0.5
Shinhan Bank Co., Ltd.	3.32%	01/29/2027	1,885	2,098,027	0.5
Skandinaviska Enskilda Banken AB, Series 580.	1.00%	12/17/2025	SEK 14,000	1,336,732	0.3
Sumitomo Mitsui Banking Corp., Series E.	3.60%	02/16/2026	EUR 455	505,472	0.1
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., Series E.	3.63%	04/06/2026	1,264	1,407,678	0.3
Westpac Banking Corp.	1.08%	04/05/2027	2,097	2,215,783	0.5
				<u>21,290,656</u>	<u>4.7</u>
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN					
BELGIEN					
Dexia SA, Series E.	2.13%	02/12/2025	GBP 6,200	8,041,824	1.8
FRANKREICH					
SNCF Reseau, Series E.	1.13%	05/19/2027	EUR 2,600	2,744,426	0.6
Societe Nationale SNCF SACA.	3.13%	11/02/2027	800	889,644	0.2
UNEDIC ASSEO, Series E.	1.25%	03/28/2027	1,800	1,915,594	0.4
UNEDIC ASSEO, Series E.	1.25%	10/21/2027	800	845,218	0.2
				<u>6,394,882</u>	<u>1.4</u>
JAPAN					
Development Bank of Japan, Inc., Series G.	2.13%	09/01/2026	2,186	2,381,763	0.5
Development Bank of Japan, Inc., Series G.	3.50%	09/13/2027	856	966,604	0.2
				<u>3,348,367</u>	<u>0.7</u>
NIEDERLANDE					
BNG Bank NV.	3.25%	08/24/2026	AUD 4,778	3,171,994	0.7
				<u>20,957,067</u>	<u>4.6</u>
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal National Mortgage Association, Series 2001.	7.00%	09/01/2031	USD 1	641	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2024, TBA. ..	3.00%	09/01/2054	2,532	2,290,024	0.5
Government National Mortgage Association, Series 2024, TBA. ..	4.50%	09/01/2054	3,477	3,402,993	0.8
Government National Mortgage Association, Series 2024, TBA. ..	5.00%	09/01/2054	3,399	3,391,428	0.7
Government National Mortgage Association, Series 2024, TBA. ..	5.50%	09/01/2054	2,000	2,012,735	0.4
Government National Mortgage Association, Series 2024, TBA. ..	6.00%	09/01/2054	4,410	4,474,259	1.0
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2024, TBA.	5.50%	09/01/2054	4,397	4,427,059	1.0
				<u>19,999,139</u>	<u>4.4</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – KOMMUNALANLEIHEN					
KANADA					
Province of British Columbia Canada.	2.50%	02/26/2027	AUD 1,461	942,124	0.2
Province of British Columbia Canada.	4.25%	11/27/2024	3,010	2,035,174	0.4
Province of Manitoba Canada.	3.75%	06/09/2026	1,971	1,321,531	0.3
Province of Ontario Canada, Series DIP.	3.10%	08/26/2025	4,545	3,034,476	0.7
Province of Quebec Canada.	3.70%	05/20/2026	1,102	738,691	0.2
Province of Quebec Canada.	4.20%	03/10/2025	5,448	3,679,735	0.8
				<u>11,751,731</u>	<u>2.6</u>
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
DEUTSCHLAND					
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau.	4.10%	02/20/2026	3,811	2,580,223	0.6
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, Series E.	1.38%	12/15/2025	GBP 4,555	5,747,795	1.2
				<u>8,328,018</u>	<u>1.8</u>
SÜDKOREA					
Korea International Bond.	0.00%	10/15/2026	EUR 1,737	1,799,499	0.4
				<u>10,127,517</u>	<u>2.2</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class A1(a).	6.70%	07/20/2034	USD 1,646	1,646,592	0.4
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 Ltd., Series 2021-42A, Class A(a).	6.65%	07/16/2035	1,434	1,435,889	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 43 Ltd., Series 2021-43A, Class A(a)	6.68%	07/17/2035	USD 1,672	\$ 1,673,637	0.4%
New Mountain CLO 3 Ltd., Series CLO-3A, Class A(a)	6.72%	10/20/2034	1,018	1,018,793	0.2
				<u>5,774,911</u>	<u>1.3</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2021-R01, Class 1M2(a)	6.90%	10/25/2041	70	70,337	0.0
Series 2021-R03, Class 1M1(a)	6.20%	12/25/2041	229	228,673	0.1
Series 2022-R08, Class 1M1(a)	7.90%	07/25/2042	162	166,367	0.1
Series 2024-R04, Class 1M1(a)	6.45%	05/25/2044	552	551,926	0.1
Eagle RE Ltd., Series 2021-2, Class M1B(a)	7.40%	04/25/2034	83	83,472	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2021-DNA5, Class M2(a)	7.00%	01/25/2034	160	161,362	0.0
Series 2021-DNA6, Class M1(a)	6.15%	10/25/2041	12	12,198	0.0
Series 2021-DNA6, Class M2(a)	6.85%	10/25/2041	812	815,416	0.2
Series 2021-HQA4, Class M1(a)	6.30%	12/25/2041	568	565,268	0.1
Series 2022-DNA3, Class M1A(a)	7.35%	04/25/2042	415	419,708	0.1
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
Series 2014-C04, Class 1M2(a)	10.36%	11/25/2024	480	484,144	0.1
Series 2016-C02, Class 1M2(a)	11.46%	09/25/2028	155	160,439	0.0
				<u>3,719,310</u>	<u>0.8</u>
QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
SÜDKOREA					
Export-Import Bank of Korea	0.83%	04/27/2025	EUR 1,265	1,373,203	0.3
Korea National Oil Corp.	4.75%	04/03/2026	USD 1,381	1,379,343	0.3
				<u>2,752,546</u>	<u>0.6</u>
SUPRANATIONALE UNTERNEHMEN					
European Bank for Reconstruction & Development, Series G	6.30%	10/26/2027	INR 180,300	2,122,433	0.5
				<u>450,840,125</u>	<u>99.5</u>
GELDMARKTINSTRUMENTE					
SCHATZWECHSEL					
Japan Treasury Discount Bill, Series 1249	0.00%	11/11/2024	JPY 659,850	4,512,607	1.0
				<u>455,352,732</u>	<u>100.5</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2021-4A, Class A1(a)	6.71%	10/20/2034	USD 1,144	1,145,278	0.3
Ballyrock CLO 16 Ltd., Series 2021-16A, Class A1(a)	6.67%	07/20/2034	1,106	1,106,919	0.2
				<u>2,252,197</u>	<u>0.5</u>
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSZAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal National Mortgage Association, Series 1999	7.00%	09/01/2029	0*	210	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 1999	7.00%	10/01/2029	1	842	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 1999	7.00%	10/01/2029	0*	43	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2000	7.00%	12/01/2030	1	639	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	09/01/2031	2	2,420	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	09/01/2031	1	1,213	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	09/01/2031	0*	150	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	09/01/2031	0*	60	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	11/01/2031	2	2,493	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	12/01/2031	3	2,856	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	12/01/2031	1	1,465	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	12/01/2031	0*	348	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	01/01/2032	1	901	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2002	7.00%	02/01/2032	1	876	0.0
				<u>14,516</u>	<u>0.0</u>
				<u>2,266,713</u>	<u>0.5</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$452,038,651)				\$ 457,619,445	101.0%
Termineinlagen					
ANZ, Hong Kong(b)	3.44 %	–		25,035	0.0
BBH, New York(b)	6.46 %	–		1	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.50 %	–		801	0.0
Citibank, New York(b)	4.68 %	–		9,773,252	2.2
DNB, Oslo(b)	3.05 %	–		209,090	0.0

AB FCP I
Short Duration Bond Portfolio

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettöver- mögen %
HSBC, London(b)	3.90 %	–	\$ 45,545	0.0%
HSBC, Paris(b)	2.62 %	–	309,835	0.1
HSBC, Singapore(b)	2.11 %	–	45,166	0.0
Scotiabank, Toronto(b)	3.30 %	–	45,649	0.0
Termineinlagen insgesamt			<u>10,454,374</u>	<u>2.3</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			<u>(14,906,632)</u>	<u>(3.3)</u>
Nettövermögen			<u>\$ 453,167,187</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Long					
Korea 3 Yr Bond Futures	09/13/2024	52	\$ 4,084,950	\$ 4,115,313	\$ 30,363
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	12/31/2024	119	24,737,648	24,698,078	(39,570)
Short					
Australian 3 Yr Bond Futures	09/16/2024	69	4,939,739	4,994,547	(54,808)
Euro-BOBL Futures	12/06/2024	67	8,812,614	8,810,392	2,222
Euro-Schatz Futures	12/06/2024	228	26,891,729	26,879,127	12,601
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	12/31/2024	77	8,436,898	8,423,680	13,219
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	12/19/2024	48	5,480,273	5,451,000	29,273
					<u>\$ (6,700)</u>
				Wertsteigerung	\$ 87,678
				Wertminderung	\$ (94,378)

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.	HUF 27,821	USD 76	09/12/2024	\$ (2,170)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3	EUR 3	09/09/2024	38
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 0**	EUR 0**	09/09/2024	(0)**
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 288	USD 195	09/23/2024	160
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 59	USD 40	09/23/2024	(109)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 58	USD 65	09/23/2024	550
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 0**	USD 0**	09/23/2024	–
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 7,106	AUD 10,539	09/23/2024	30,259
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 28	AUD 40	09/23/2024	(89)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,508	CAD 3,416	09/23/2024	28,362
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 28,985	EUR 26,082	09/23/2024	(128,962)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,227	GBP 2,477	09/23/2024	26,733
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 624	NZD 1,016	09/23/2024	10,422
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 442	SGD 576	09/23/2024	331
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3	EUR 3	09/30/2024	(33)
Citibank NA	CZK 76,923	USD 3,345	09/12/2024	(52,345)
Citibank NA	PEN 3,999	USD 1,060	09/12/2024	(6,424)
Citibank NA	USD 6,410	COP 26,118,784	09/12/2024	(171,783)
Citibank NA	USD 1,126	CZK 25,875	09/12/2024	16,764
Citibank NA	USD 1,086	HUF 387,727	09/12/2024	3,912
Citibank NA	USD 1,070	PEN 4,011	09/12/2024	202
Citibank NA	INR 182,566	USD 2,180	09/13/2024	3,492
Citibank NA	INR 93,311	USD 1,111	09/13/2024	(1,541)
Citibank NA	USD 4,487	INR 376,823	09/13/2024	5,807
Citibank NA	USD 3,163	INR 264,801	09/13/2024	(5,847)
Citibank NA	IDR 34,620,007	USD 2,122	10/25/2024	(106,339)
Citibank NA	USD 1,031	IDR 16,677,242	10/25/2024	42,439
Deutsche Bank AG	AUD 753	USD 508	09/13/2024	(1,963)
Deutsche Bank AG	CAD 4,279	USD 3,154	09/13/2024	(22,138)
HSBC Bank USA	COP 25,306,876	USD 6,327	09/12/2024	283,328
HSBC Bank USA	CZK 25,881	USD 1,120	09/12/2024	(22,594)
HSBC Bank USA	GBP 17,257	USD 22,469	09/12/2024	(196,775)
HSBC Bank USA	HUF 388,846	USD 1,072	09/12/2024	(21,875)
HSBC Bank USA	JPY 659,733	USD 4,544	09/12/2024	25,779
HSBC Bank USA	SEK 35,451	USD 3,458	09/12/2024	3,841
HSBC Bank USA	USD 1,137	CNH 8,087	09/12/2024	5,351
HSBC Bank USA	USD 1,132	PEN 4,230	09/12/2024	(3,712)
HSBC Bank USA	USD 1,039	INR 87,198	09/13/2024	203
HSBC Bank USA	IDR 34,428,531	USD 2,164	10/25/2024	(52,444)
HSBC Bank USA	USD 1,072	IDR 17,134,351	10/25/2024	30,941

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausbungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
JPMorgan Chase Bank NA	COP 8,568,908	USD 2,104	09/12/2024	\$ 57,863
JPMorgan Chase Bank NA	HUF 401,090	USD 1,140	09/12/2024	11,605
JPMorgan Chase Bank NA	HUF 385,529	USD 1,067	09/12/2024	(17,117)
JPMorgan Chase Bank NA	USD 1,067	CZK 24,939	09/12/2024	34,615
JPMorgan Chase Bank NA	USD 1,052	HUF 384,585	09/12/2024	29,387
JPMorgan Chase Bank NA	USD 1,133	HUF 401,227	09/12/2024	(4,775)
JPMorgan Chase Bank NA	SGD 1,548	USD 1,186	09/13/2024	(746)
JPMorgan Chase Bank NA	USD 1,142	SGD 1,490	09/13/2024	88
Merrill Lynch, Pierce, Fenner & Smith, Inc.	CLP 2,063,933	USD 2,241	09/12/2024	(17,609)
Merrill Lynch, Pierce, Fenner & Smith, Inc.	COP 5,155,604	USD 1,273	09/12/2024	42,006
Merrill Lynch, Pierce, Fenner & Smith, Inc.	COP 13,417,556	USD 3,177	09/12/2024	(27,239)
Merrill Lynch, Pierce, Fenner & Smith, Inc.	PEN 4,229	USD 1,124	09/12/2024	(4,560)
Merrill Lynch, Pierce, Fenner & Smith, Inc.	USD 1,089	CZK 25,027	09/12/2024	16,702
Merrill Lynch, Pierce, Fenner & Smith, Inc.	USD 1,071	PEN 3,997	09/12/2024	(4,368)
Merrill Lynch, Pierce, Fenner & Smith, Inc.	INR 177,234	USD 2,114	09/13/2024	784
Merrill Lynch, Pierce, Fenner & Smith, Inc.	INR 179,220	USD 2,129	09/13/2024	(7,556)
Merrill Lynch, Pierce, Fenner & Smith, Inc.	KRW 3,096,453	USD 2,270	10/18/2024	(51,093)
Merrill Lynch, Pierce, Fenner & Smith, Inc.	USD 1,097	KRW 1,489,514	10/18/2024	19,892
Morgan Stanley Capital Services LLC	CZK 24,902	USD 1,069	09/12/2024	(31,080)
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR 5,031	USD 5,595	09/12/2024	31,712
Morgan Stanley Capital Services LLC	JPY 7,997,714	USD 54,905	09/12/2024	133,629
Morgan Stanley Capital Services LLC	PEN 4,010	USD 1,067	09/12/2024	(2,571)
Morgan Stanley Capital Services LLC	AUD 24,999	USD 16,633	09/19/2024	(293,684)
Morgan Stanley Capital Services LLC	KRW 219,524	USD 160	10/18/2024	(4,291)
Morgan Stanley Capital Services LLC	MYR 11,035	USD 2,531	11/21/2024	(35,681)
Societe Generale	EUR 110,123	USD 122,356	09/12/2024	581,402
Standard Chartered Bank	USD 7,520	EUR 6,751	09/12/2024	(54,378)
Standard Chartered Bank	PLN 4,587	USD 1,191	09/13/2024	6,967
Standard Chartered Bank	USD 1,066	IDR 16,686,101	10/25/2024	7,983
Standard Chartered Bank	USD 926	IDR 14,242,952	10/25/2024	(8,862)
				\$ 130,796
			Wertsteigerung	\$ 1,493,549
			Wertminderung	\$ (1,362,753)

+ Zur Absicherung des Portfolios oder der Anteilklassen.

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nomineller Betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	SEK 47,972	08/30/2026	2.290%	3 Month STIBOR	\$ (3,083)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	SEK 47,973	09/02/2026	2.265%	3 Month STIBOR	(1,459)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	SEK 47,972	09/02/2026	2.257%	3 Month STIBOR	(737)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	SEK 47,972	09/02/2026	2.298%	3 Month STIBOR	(4,437)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	SEK 43,891	09/02/2026	2.250%	3 Month STIBOR	(96)
Insgesamt					\$ (9,812)

* Kapitalbetrag geringer als 500.

** Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

*** Betrag weniger als 0.50.

(a) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 30. August 2024.

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar

CAD – Canadian Dollar

CLP – Chilean Peso

CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)

COP – Colombian Peso

CZK – Czech Koruna

EUR – Euro

GBP – Great British Pound
HUF – Hungarian Forint
IDR – Indonesian Rupiah
INR – Indian Rupee
JPY – Japanese Yen
KRW – South Korean Won
MYR – Malaysian Ringgit
NZD – New Zealand Dollar
PEN – Peruvian Sol
PLN – Polish Zloty
SEK – Swedish Krona
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar

Glossar:

BOBL – Bundesobligation
CBT – Chicago Board of Trade
CLO – Collateralized Loan Obligations
LCH – London Clearing House
OAT – Obligations Assimilables du Trésor
STIBOR – Stockholm Interbank Offered Rate
TBA – To Be Announced

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
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	\$ 2,755,932	0.0%
Alcoa Nederland Holding BV	4.13%	03/31/2029	800	765,817	0.0
Alcoa Nederland Holding BV	7.13%	03/15/2031	4,800	5,052,392	0.0
Arsenal AIC Parent LLC	8.00%	10/01/2030	11,917	12,830,361	0.1
Ashland, Inc.	3.38%	09/01/2031	3,000	2,637,541	0.0
ASP Unifrax Holdings, Inc.	5.25%	09/30/2028	29,026	15,024,320	0.1
Axalta Coating Systems LLC	3.38%	02/15/2029	700	650,931	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	7.00%	03/15/2032	25,414	25,530,593	0.2
Constellium SE	3.13%	07/15/2029	EUR 10,042	10,386,151	0.1
Constellium SE	3.75%	04/15/2029	USD 12,657	11,726,535	0.1
CVR Partners LP/CVR Nitrogen Finance Corp.	6.13%	06/15/2028	18,045	17,538,035	0.1
Element Solutions, Inc.	3.88%	09/01/2028	14,985	14,180,764	0.1
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	4.38%	04/01/2031	29,340	26,774,023	0.2
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	4.50%	09/15/2027	4,348	4,189,038	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	5.88%	04/15/2030	139	138,150	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	6.13%	04/15/2032	42,618	42,552,571	0.3
Graphic Packaging International LLC	3.50%	03/15/2028	5,800	5,478,088	0.0
Graphic Packaging International LLC	3.75%	02/01/2030	3,700	3,423,076	0.0
Graphic Packaging International LLC	6.38%	07/15/2032	8,979	9,179,780	0.1
INEOS Finance PLC	6.38%	04/15/2029	EUR 14,780	16,919,347	0.1
INEOS Finance PLC	7.50%	04/15/2029	USD 9,355	9,688,633	0.1
INEOS Quattro Finance 2 PLC	8.50%	03/15/2029	EUR 17,984	21,122,038	0.1
INEOS Quattro Finance 2 PLC	9.63%	03/15/2029	USD 5,196	5,583,259	0.0
Ingevity Corp.	3.88%	11/01/2028	8,528	7,907,162	0.1
Intelligent Packaging Holdco Issuer LP(a)	9.00%	01/15/2026	12,133	11,817,354	0.1
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc./ Intelligent Packaging Ltd. Co-Issuer LLC	6.00%	09/15/2028	22,066	21,730,893	0.1
Methanex Corp.	5.13%	10/15/2027	989	972,856	0.0
Methanex Corp.	5.25%	12/15/2029	1,078	1,059,657	0.0
Olympus Water US Holding Corp.	7.13%	10/01/2027	9,353	9,526,183	0.1
Olympus Water US Holding Corp.	9.75%	11/15/2028	33,666	35,916,729	0.2
Roller Bearing Co. of America, Inc.	4.38%	10/15/2029	1,800	1,711,673	0.0
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	5.38%	11/01/2026	35,569	34,969,616	0.2
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	9.50%	07/15/2028	EUR 3,273	3,919,016	0.0
Sealed Air Corp.	4.00%	12/01/2027	USD 12,600	12,174,541	0.1
Sealed Air Corp.	5.00%	04/15/2029	404	396,407	0.0
Sealed Air Corp./Sealed Air Corp. US.	6.13%	02/01/2028	5,295	5,389,426	0.0
Vallourec SACA.	7.50%	04/15/2032	11,782	12,419,472	0.1
Vibrantz Technologies, Inc.	9.00%	02/15/2030	30,090	27,546,633	0.2
WR Grace Holdings LLC	5.63%	08/15/2029	25,678	23,807,966	0.2
				<u>475,392,959</u>	<u>3.1</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Arcosa, Inc.	6.88%	08/15/2032	6,718	7,003,828	0.1
ARD Finance SA(a)	5.00%	06/30/2027	EUR 50,431	10,827,864	0.1
ARD Finance SA(a)	6.50%	06/30/2027	USD 14,019	3,234,872	0.0
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/ Ardagh Metal Packaging Finance PLC	4.00%	09/01/2029	1,000	861,877	0.0
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/ Ardagh Metal Packaging Finance PLC	6.00%	06/15/2027	6,731	6,714,173	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	2.13%	08/15/2026	EUR 20,358	18,621,839	0.1
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	4.13%	08/15/2026	USD 15,103	13,016,314	0.1
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	5.25%	08/15/2027	3,000	1,805,640	0.0
Ball Corp.	2.88%	08/15/2030	2,000	1,766,756	0.0
Ball Corp.	6.00%	06/15/2029	15,602	16,052,862	0.1
Bombardier, Inc.	6.00%	02/15/2028	37	37,005	0.0
Bombardier, Inc.	7.00%	06/01/2032	4,779	4,968,973	0.0
Bombardier, Inc.	7.25%	07/01/2031	6,936	7,284,028	0.1
Bombardier, Inc.	7.45%	05/01/2034	2,799	3,053,069	0.0
Bombardier, Inc.	7.50%	02/01/2029	903	947,570	0.0
Bombardier, Inc.	7.88%	04/15/2027	627	628,830	0.0
Bombardier, Inc.	8.75%	11/15/2030	21,970	24,005,367	0.2
Calderys Financing LLC	11.25%	06/01/2028	31,200	33,848,563	0.2
Chart Industries, Inc.	7.50%	01/01/2030	8,185	8,606,210	0.1
Clean Harbors, Inc.	5.13%	07/15/2029	2,611	2,564,285	0.0
Clean Harbors, Inc.	6.38%	02/01/2031	2,813	2,873,502	0.0
Crown Americas LLC	5.25%	04/01/2030	9,684	9,672,386	0.1
Crown European Holdings SACA	4.75%	03/15/2029	EUR 229	260,445	0.0
Crown European Holdings SACA	5.00%	05/15/2028	992	1,136,870	0.0
Eco Material Technologies, Inc.	7.88%	01/31/2027	USD 35,488	35,868,960	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
EMRLD Borrower LP/Emerald Co-Issuer, Inc.	6.63%	12/15/2030	USD 8,099	\$ 8,304,143	0.1%
EnerSys	4.38%	12/15/2027	18,085	17,665,598	0.1
EnerSys	6.63%	01/15/2032	9,501	9,958,041	0.1
Enviri Corp.	5.75%	07/31/2027	16,968	16,442,748	0.1
Esab Corp.	6.25%	04/15/2029	11,308	11,600,647	0.1
F-Brasile SpA/F-Brasile US LLC, Series XR	7.38%	08/15/2026	20,200	20,203,165	0.1
GFL Environmental, Inc.	3.50%	09/01/2028	1,000	945,403	0.0
GFL Environmental, Inc.	6.75%	01/15/2031	8,097	8,465,261	0.1
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028	33,314	32,684,786	0.2
Hillenbrand, Inc.	6.25%	02/15/2029	927	940,194	0.0
Husky Injection Molding Systems Ltd./Titan Co-Borrower LLC ..	9.00%	02/15/2029	9,666	9,910,263	0.1
IMA Industria Macchine Automatiche SpA.	3.75%	01/15/2028	EUR 7,200	7,671,250	0.1
IMA Industria Macchine Automatiche SpA(b)	7.44%	04/15/2029	6,280	7,001,486	0.1
LSB Industries, Inc.	6.25%	10/15/2028	USD 26,502	25,973,078	0.2
Madison IAQ LLC	5.88%	06/30/2029	32,314	30,831,713	0.2
MIWD Holdco II LLC/MIWD Finance Corp.	5.50%	02/01/2030	28,752	27,353,240	0.2
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027	7,075	6,801,212	0.0
Mueller Water Products, Inc.	4.00%	06/15/2029	2,000	1,889,971	0.0
Paprec Holding SA.	7.25%	11/17/2029	EUR 4,100	4,786,381	0.0
Reworld Holding Corp.	4.88%	12/01/2029	USD 1,500	1,392,653	0.0
Spirit AeroSystems, Inc.	9.38%	11/30/2029	920	998,572	0.0
Spirit AeroSystems, Inc.	9.75%	11/15/2030	79	88,437	0.0
Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp.	7.25%	01/15/2031	6,026	6,373,387	0.0
Terex Corp.	5.00%	05/15/2029	1,800	1,748,874	0.0
TK Elevator Midco GmbH	4.38%	07/15/2027	EUR 1,200	1,305,306	0.0
Trinity Industries, Inc.	7.75%	07/15/2028	USD 23,587	24,712,478	0.2
Triumph Group, Inc.	9.00%	03/15/2028	36,396	38,519,470	0.2
Trivium Packaging Finance BV.	5.50%	08/15/2026	800	790,445	0.0
				541,020,290	3.6
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Advantage Sales & Marketing, Inc.	6.50%	11/15/2028	15,229	14,293,741	0.1
AMC Networks, Inc.	4.25%	02/15/2029	7,963	5,659,821	0.0
AMC Networks, Inc.	10.25%	01/15/2029	37,549	37,737,364	0.2
Arches Buyer, Inc.	4.25%	06/01/2028	1,728	1,573,134	0.0
Arches Buyer, Inc.	6.13%	12/01/2028	8,568	7,272,295	0.1
Banjijay Entertainment SAS	7.00%	05/01/2029	EUR 8,362	9,736,430	0.1
Banjijay Entertainment SAS	8.13%	05/01/2029	USD 12,775	13,243,818	0.1
Bertelsmann SE & Co. KGaA	3.50%	04/23/2075	EUR 600	649,722	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.25%	02/01/2031	USD 4,292	3,725,850	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.25%	01/15/2034	22,642	18,254,359	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	08/15/2030	21,000	18,731,143	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	06/01/2033	5,160	4,308,761	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.75%	02/01/2032	22,374	19,498,975	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.00%	02/01/2028	1,000	961,966	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	6.38%	09/01/2029	10,989	10,855,163	0.1
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027	35,824	35,001,954	0.2
CSC Holdings LLC	4.50%	11/15/2031	5,000	3,325,895	0.0
CSC Holdings LLC	4.63%	12/01/2030	7,112	2,778,660	0.0
CSC Holdings LLC	5.38%	02/01/2028	18,190	13,949,448	0.1
CSC Holdings LLC	5.50%	04/15/2027	6,673	5,460,472	0.0
CSC Holdings LLC	5.75%	01/15/2030	27,919	11,026,208	0.1
CSC Holdings LLC	7.50%	04/01/2028	2,364	1,188,005	0.0
CSC Holdings LLC	11.25%	05/15/2028	4,448	3,950,646	0.0
CSC Holdings LLC	11.75%	01/31/2029	6,703	5,913,891	0.0
DISH DBS Corp.	5.25%	12/01/2026	38,741	33,131,708	0.2
DISH DBS Corp.	5.75%	12/01/2028	30,009	23,016,444	0.1
DISH DBS Corp.	5.88%	11/15/2024	4,019	3,887,753	0.0
DISH Network Corp.(c)	3.38%	08/15/2026	6,494	4,067,479	0.0
Gray Television, Inc.	5.38%	11/15/2031	13,603	7,788,874	0.1
Gray Television, Inc.	7.00%	05/15/2027	18,313	17,596,529	0.1
Lamar Media Corp.	4.88%	01/15/2029	2,301	2,260,101	0.0
LCPR Senior Secured Financing DAC	5.13%	07/15/2029	27,724	22,417,308	0.1
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027	32,395	29,572,323	0.2
McGraw-Hill Education, Inc.	5.75%	08/01/2028	27,493	26,951,211	0.2
Neptune Bidco US, Inc.	9.29%	04/15/2029	51,848	51,774,853	0.3
Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp.	4.63%	03/15/2030	8,826	8,285,626	0.1
Paramount Global	6.25%	02/28/2057	897	773,510	0.0
Paramount Global	6.38%	03/30/2062	17,527	15,966,383	0.1
Radiate Holdco LLC/Radiate Finance, Inc.	4.50%	09/15/2026	24,252	19,208,610	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030	15,712	9,389,188	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	4.00%	07/15/2028	36,986	34,676,072	0.2
Summer BC Bidco B LLC	5.50%	10/31/2026	6,800	6,666,158	0.0
Summer BC Holdco B SARL	5.75%	10/31/2026	EUR 18,418	20,238,739	0.1
Sunrise FinCo I BV	4.88%	07/15/2031	USD 800	746,840	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
TEGNA, Inc.	4.63%	03/15/2028	USD 16,661	\$ 15,656,990	0.1%
TEGNA, Inc.	4.75%	03/15/2026	4,806	4,749,104	0.0
TEGNA, Inc.	5.00%	09/15/2029	17,930	16,636,154	0.1
Telenet Finance Luxembourg Notes SARL	5.50%	03/01/2028	6,000	5,810,541	0.0
Univision Communications, Inc.	6.63%	06/01/2027	31,888	31,565,209	0.2
Univision Communications, Inc.	8.50%	07/31/2031	14,362	14,329,142	0.1
Urban One, Inc.	7.38%	02/01/2028	37,387	27,238,957	0.2
Virgin Media Finance PLC	3.75%	07/15/2030	EUR 700	685,117	0.0
Virgin Media Finance PLC	5.00%	07/15/2030	USD 8,800	7,629,264	0.1
Virgin Media Secured Finance PLC	5.50%	05/15/2029	2,952	2,802,130	0.0
Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC	5.00%	07/15/2028	5,100	4,826,653	0.0
VZ Secured Financing BV	3.50%	01/15/2032	EUR 6,945	6,948,606	0.0
VZ Secured Financing BV	5.00%	01/15/2032	USD 9,215	8,356,543	0.1
Ziggo Bond Co. BV	5.13%	02/28/2030	8,737	7,880,470	0.1
Ziggo BV	2.88%	01/15/2030	EUR 2,374	2,384,121	0.0
Ziggo BV	4.88%	01/15/2030	USD 2,606	2,423,868	0.0
				<u>747,436,299</u>	<u>4.4</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Altice Financing SA	3.00%	01/15/2028	EUR 700	610,940	0.0
Altice Financing SA	5.75%	08/15/2029	USD 42,404	32,681,243	0.2
Altice France Holding SA	4.00%	02/15/2028	EUR 5,527	1,885,432	0.0
Altice France Holding SA	6.00%	02/15/2028	USD 5,977	1,926,019	0.0
Altice France Holding SA	10.50%	05/15/2027	16,348	6,389,187	0.0
Altice France SA	5.13%	01/15/2029	5,237	3,630,651	0.0
Altice France SA	5.13%	07/15/2029	19,282	13,496,335	0.1
Altice France SA	5.50%	01/15/2028	4,443	3,167,707	0.0
Altice France SA	5.50%	10/15/2029	27,360	19,288,800	0.1
Altice France SA	5.88%	02/01/2027	EUR 1,200	1,014,760	0.0
Altice France SA	8.13%	02/01/2027	USD 15,729	12,684,232	0.1
Eutelsat SA	1.50%	10/13/2028	EUR 300	272,445	0.0
Frontier Communications Holdings LLC	8.63%	03/15/2031	USD 663	702,184	0.0
Iliad Holding SASU	6.50%	10/15/2026	4,573	4,617,308	0.0
Lorca Telecom Bondco SA	4.00%	09/18/2027	EUR 2,686	2,951,593	0.0
Nexstar Media, Inc.	5.63%	07/15/2027	USD 24,783	24,218,758	0.2
Optics Bidco SpA	6.00%	09/30/2034	1,879	1,838,800	0.0
Optics Bidco SpA	6.88%	02/15/2028	EUR 100	119,932	0.0
Optics Bidco SpA	7.20%	07/18/2036	USD 24,498	25,648,730	0.2
Optics Bidco SpA	7.72%	06/04/2038	9,464	10,241,679	0.1
Optics Bidco SpA	7.88%	07/31/2028	EUR 225	280,898	0.0
Optics Bidco SpA, Series 2033	6.38%	11/15/2033	USD 477	478,457	0.0
Optics Bidco SpA, Series E	5.25%	03/17/2055	EUR 100	108,134	0.0
Telecom Italia Capital SA	6.00%	09/30/2034	USD 121	117,339	0.0
Telecom Italia Capital SA	6.38%	11/15/2033	81	81,947	0.0
Telecom Italia Capital SA	7.20%	07/18/2036	8,199	8,427,894	0.1
Telecom Italia Capital SA	7.72%	06/04/2038	4,406	4,675,172	0.0
Telecom Italia Finance SA, Series E	7.75%	01/24/2033	EUR 16	21,492	0.0
Telecom Italia SpA/Milano	7.88%	07/31/2028	156	192,899	0.0
Telecom Italia SpA/Milano, Series E	5.25%	03/17/2055	100	107,777	0.0
United Group BV	3.63%	02/15/2028	5,387	5,738,421	0.0
United Group BV	4.00%	11/15/2027	14,021	15,211,614	0.1
United Group BV	4.63%	08/15/2028	3,991	4,355,263	0.0
United Group BV	6.75%	02/15/2031	4,221	4,911,967	0.0
United States Cellular Corp.	6.70%	12/15/2033	USD 1,010	1,111,674	0.0
Vmed O2 UK Financing I PLC	4.75%	07/15/2031	48,364	42,455,363	0.3
Vodafone Group PLC	3.25%	06/04/2081	1,005	957,806	0.0
Vodafone Group PLC	4.13%	06/04/2081	17,526	15,650,675	0.1
Vodafone Group PLC	4.88%	10/03/2078	GBP 831	1,079,095	0.0
Vodafone Group PLC	5.13%	06/04/2081	USD 195	152,257	0.0
				<u>273,502,879</u>	<u>1.6</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Adient Global Holdings Ltd.	8.25%	04/15/2031	2,800	2,975,923	0.0
Allison Transmission, Inc.	3.75%	01/30/2031	1,000	908,706	0.0
Allison Transmission, Inc.	5.88%	06/01/2029	7,094	7,117,648	0.1
American Axle & Manufacturing, Inc.	5.00%	10/01/2029	3,000	2,788,530	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.25%	03/15/2026	467	468,657	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.50%	04/01/2027	1,890	1,900,624	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.88%	07/01/2028	16,111	16,181,988	0.1
Aston Martin Capital Holdings Ltd.	10.00%	03/31/2029	31,000	31,555,049	0.2
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	6.25%	05/15/2026	3,621	3,624,786	0.0
Dana, Inc.	4.25%	09/01/2030	5,000	4,512,723	0.0
Dana, Inc.	4.50%	02/15/2032	19,828	17,582,650	0.1
Dana, Inc.	5.38%	11/15/2027	232	229,857	0.0
Dana, Inc.	5.63%	06/15/2028	3,358	3,312,814	0.0
Garrett Motion Holdings, Inc./Garrett LX I SARL	7.75%	05/31/2032	19,794	20,513,455	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Goodyear Tire & Rubber Co. (The).....	5.25%	07/15/2031	USD 17,454	\$ 15,857,773	0.1%
Goodyear Tire & Rubber Co. (The).....	5.63%	04/30/2033	7,675	6,757,983	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(a).....	4.75%	09/15/2026	15,039	14,721,546	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(a).....	6.00%	05/15/2027	15,596	15,391,165	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(a).....	6.38%	05/15/2029	18,035	17,747,794	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(a).....	8.75%	05/15/2028	EUR 9,672	11,413,061	0.1
Mclaren Finance PLC.....	7.50%	08/01/2026	USD 31,275	27,525,441	0.2
PM General Purchaser LLC.....	9.50%	10/01/2028	45,899	47,061,890	0.3
Real Hero Merger Sub 2, Inc.	6.25%	02/01/2029	20,634	17,862,861	0.1
Tenneco, Inc.	8.00%	11/17/2028	37,302	34,818,205	0.2
Titan International, Inc.	7.00%	04/30/2028	27,723	27,099,679	0.2
ZF Europe Finance BV.....	2.00%	02/23/2026	EUR 300	320,726	0.0
ZF Europe Finance BV.....	3.00%	10/23/2029	100	102,217	0.0
ZF Europe Finance BV, Series E.....	6.13%	03/13/2029	300	349,531	0.0
ZF Finance GmbH, Series E.....	2.00%	05/06/2027	200	208,473	0.0
ZF Finance GmbH, Series E.....	3.00%	09/21/2025	1,000	1,090,993	0.0
ZF Finance GmbH, Series E.....	3.75%	09/21/2028	5,000	5,346,564	0.0
ZF North America Capital, Inc.....	4.75%	04/29/2025	USD 21,008	20,817,119	0.1
ZF North America Capital, Inc.....	6.75%	04/23/2030	21,607	22,191,500	0.1
ZF North America Capital, Inc.....	6.88%	04/14/2028	4,434	4,584,378	0.0
ZF North America Capital, Inc.....	7.13%	04/14/2030	13,278	13,914,636	0.1
				418,856,945	2.4
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Boyne USA, Inc.	4.75%	05/15/2029	700	671,511	0.0
Carnival Corp.	5.75%	03/01/2027	30,886	30,983,950	0.2
Carnival Corp.	5.75%	01/15/2030	EUR 5,960	6,910,214	0.0
Carnival Corp.	10.50%	06/01/2030	USD 5,000	5,425,000	0.0
Carnival PLC.....	1.00%	10/28/2029	EUR 307	286,783	0.0
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op.....	5.25%	07/15/2029	USD 2,135	2,103,546	0.0
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op.....	5.38%	04/15/2027	8,970	8,928,694	0.1
Lindblad Expeditions LLC.....	6.75%	02/15/2027	9,468	9,406,237	0.1
Loarre Investments SARL.....	6.50%	05/15/2029	EUR 12,810	14,441,095	0.1
Merlin Entertainments Group US Holdings, Inc.	7.38%	02/15/2031	USD 14,448	14,395,761	0.1
Merlin Entertainments Ltd.	5.75%	06/15/2026	16,847	16,619,441	0.1
Motion Bondco DAC.....	4.50%	11/15/2027	EUR 13,300	13,655,921	0.1
Motion Finco SARL.....	7.38%	06/15/2030	4,231	4,712,232	0.0
NCL Corp., Ltd.....	5.88%	03/15/2026	USD 14,303	14,285,371	0.1
NCL Corp., Ltd.....	5.88%	02/15/2027	130	130,171	0.0
NCL Corp., Ltd.....	7.75%	02/15/2029	4,000	4,263,735	0.0
NCL Corp., Ltd.....	8.13%	01/15/2029	10,763	11,515,094	0.1
NCL Corp., Ltd.....	8.38%	02/01/2028	5,866	6,177,783	0.0
NCL Finance Ltd.	6.13%	03/15/2028	1,000	1,010,587	0.0
Royal Caribbean Cruises Ltd.	3.70%	03/15/2028	283	269,702	0.0
Royal Caribbean Cruises Ltd.	4.25%	07/01/2026	92	90,045	0.0
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.38%	07/15/2027	16,520	16,555,148	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	08/31/2026	18,938	18,992,545	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	04/01/2028	13,567	13,661,933	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	6.00%	02/01/2033	12,937	13,256,156	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	7.25%	01/15/2030	5,857	6,194,978	0.0
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	5.25%	08/15/2029	20,144	19,451,417	0.1
Six Flags Entertainment Corp./DE.....	5.50%	04/15/2027	2,000	1,986,922	0.0
Six Flags Entertainment Corp./DE.....	7.25%	05/15/2031	12,245	12,697,089	0.1
				269,079,061	1.6
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Assemblin Caverion Group AB.....	6.25%	07/01/2030	EUR 8,900	10,050,753	0.1
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC.....	4.88%	02/15/2030	USD 27,127	25,291,053	0.2
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC.....	6.25%	09/15/2027	19,888	19,841,430	0.1
Builders FirstSource, Inc.	4.25%	02/01/2032	2,000	1,827,851	0.0
Builders FirstSource, Inc.	5.00%	03/01/2030	3,750	3,640,832	0.0
Builders FirstSource, Inc.	6.38%	06/15/2032	20,332	20,963,124	0.1
Builders FirstSource, Inc.	6.38%	03/01/2034	6,279	6,447,419	0.0
Churchill Downs, Inc.	4.75%	01/15/2028	700	682,843	0.0
Churchill Downs, Inc.	5.50%	04/01/2027	2,000	1,990,464	0.0
Churchill Downs, Inc.	6.75%	05/01/2031	2,000	2,056,231	0.0
Cirsa Finance International SARL.....	6.50%	03/15/2029	EUR 13,923	15,935,065	0.1
Hilton Domestic Operating Co., Inc.....	3.63%	02/15/2032	USD 28,883	25,909,485	0.2
Hilton Domestic Operating Co., Inc.....	5.38%	05/01/2025	3,320	3,312,823	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.....	5.75%	05/01/2028	5,733	5,741,003	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.....	5.88%	04/01/2029	3,700	3,768,387	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.....	6.13%	04/01/2032	2,186	2,240,957	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower Esc	4.88%	07/01/2031	USD 20,756	\$ 18,584,073	0.1%
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower Esc	5.00%	06/01/2029	32,204	30,436,063	0.2
Installed Building Products, Inc.	5.75%	02/01/2028	5,705	5,654,202	0.0
KB Home	4.80%	11/15/2029	5,544	5,411,804	0.0
Light & Wonder International, Inc.	7.00%	05/15/2028	7,525	7,613,288	0.1
Marriott Ownership Resorts, Inc.	4.50%	06/15/2029	26,542	24,699,584	0.2
Marriott Ownership Resorts, Inc.	4.75%	01/15/2028	10,700	10,221,160	0.1
Masterbrand, Inc.	7.00%	07/15/2032	14,531	14,984,633	0.1
Mattamy Group Corp.	4.63%	03/01/2030	19,256	18,213,207	0.1
Mattamy Group Corp.	5.25%	12/15/2027	700	690,964	0.0
MGM Resorts International	4.75%	10/15/2028	23,322	22,715,514	0.1
MGM Resorts International	5.50%	04/15/2027	2,800	2,800,348	0.0
Miter Brands Acquisition Holdco, Inc./MIWD Borrower LLC	6.75%	04/01/2032	6,599	6,781,469	0.0
Playtech PLC	5.88%	06/28/2028	EUR 3,269	3,691,208	0.0
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	10/15/2028	USD 15,577	15,223,651	0.1
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	04/01/2029	14,461	13,896,818	0.1
Standard Building Solutions, Inc.	6.50%	08/15/2032	12,473	12,851,498	0.1
Standard Industries, Inc./NY	5.00%	02/15/2027	1,000	986,413	0.0
Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP/ Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp.	5.88%	05/15/2025	22,618	22,570,789	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.13%	08/01/2030	3,147	3,115,740	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.75%	01/15/2028	15,961	16,095,714	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.88%	06/15/2027	12,280	12,438,994	0.1
Thor Industries, Inc.	4.00%	10/15/2029	7,608	6,950,402	0.1
Travel & Leisure Co.	4.50%	12/01/2029	19,631	18,283,747	0.1
Travel & Leisure Co.	6.00%	04/01/2027	5,361	5,383,722	0.0
Travel & Leisure Co.	6.63%	07/31/2026	29,182	29,699,704	0.2
Wyndham Hotels & Resorts, Inc.	4.38%	08/15/2028	1,467	1,405,806	0.0
				<u>481,080,235</u>	<u>2.8</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	3.88%	01/15/2028	16,000	15,297,324	0.1
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	4.00%	10/15/2030	50,363	46,135,583	0.3
IRB Holding Corp.	7.00%	06/15/2025	10,678	10,688,150	0.1
Papa John's International, Inc.	3.88%	09/15/2029	5,437	4,977,867	0.0
Yum! Brands, Inc.	4.63%	01/31/2032	466	441,763	0.0
Yum! Brands, Inc.	4.75%	01/15/2030	1,108	1,087,811	0.0
				<u>78,628,498</u>	<u>0.5</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Arko Corp.	5.13%	11/15/2029	18,547	16,494,209	0.1
Asbury Automotive Group, Inc.	4.50%	03/01/2028	700	676,128	0.0
Asbury Automotive Group, Inc.	4.63%	11/15/2029	34,957	33,338,213	0.2
Asbury Automotive Group, Inc.	5.00%	02/15/2032	12,489	11,759,975	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.75%	07/01/2036	16,216	16,619,321	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.88%	11/01/2035	1,039	1,072,883	0.0
Bath & Body Works, Inc.	6.95%	03/01/2033	13,864	13,862,367	0.1
Bath & Body Works, Inc.	7.60%	07/15/2037	4,421	4,382,559	0.0
Bath & Body Works, Inc.	9.38%	07/01/2025	1,656	1,706,164	0.0
BCPE Ulysses Intermediate, Inc.(a)	7.75%	04/01/2027	19,207	18,618,814	0.1
Beacon Roofing Supply, Inc.	4.13%	05/15/2029	2,000	1,869,112	0.0
Beacon Roofing Supply, Inc.	6.50%	08/01/2030	4,271	4,386,149	0.0
Carvana Co.	5.50%	04/15/2027	2,126	1,983,410	0.0
Carvana Co.(a)	13.00%	06/01/2030	23,214	24,759,476	0.2
Cougar JV Subsidiary LLC	8.00%	05/15/2032	9,360	9,875,652	0.1
CT Investment GmbH	6.38%	04/15/2030	EUR 5,064	5,723,695	0.0
FirstCash, Inc.	4.63%	09/01/2028	USD 2,700	2,585,361	0.0
FirstCash, Inc.	5.63%	01/01/2030	19,645	19,357,347	0.1
FirstCash, Inc.	6.88%	03/01/2032	7,399	7,606,546	0.1
Foundation Building Materials, Inc.	6.00%	03/01/2029	5,396	4,850,593	0.0
Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd.	8.38%	01/15/2029	19,271	18,997,561	0.1
Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd.	8.75%	01/15/2032	27,680	26,484,876	0.2
Group 1 Automotive, Inc.	4.00%	08/15/2028	4,384	4,148,391	0.0
Group 1 Automotive, Inc.	6.38%	01/15/2030	5,813	5,913,116	0.0
Kohl's Corp.	4.63%	05/01/2031	1,261	1,042,292	0.0
Kontoor Brands, Inc.	4.13%	11/15/2029	26,253	24,747,005	0.2
LCM Investments Holdings II LLC.	4.88%	05/01/2029	8,575	8,169,624	0.1
LCM Investments Holdings II LLC.	8.25%	08/01/2031	13,819	14,690,256	0.1
Levi Strauss & Co.	3.50%	03/01/2031	4,818	4,356,306	0.0
Michaels Cos., Inc. (The)	7.88%	05/01/2029	16,724	10,020,824	0.1
Murphy Oil USA, Inc.	4.75%	09/15/2029	700	679,614	0.0
Murphy Oil USA, Inc.	5.63%	05/01/2027	1,441	1,440,946	0.0
Penske Automotive Group, Inc.	3.75%	06/15/2029	151	140,566	0.0
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.	4.75%	02/15/2028	14,016	13,405,696	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.	7.75%	02/15/2029	USD 41,041	\$ 40,423,130	0.3%
Sonic Automotive, Inc.	4.63%	11/15/2029	19,738	18,445,984	0.1
Sonic Automotive, Inc.	4.88%	11/15/2031	23,577	21,603,710	0.1
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp.	6.38%	09/30/2026	23,041	22,907,829	0.1
Staples, Inc.	10.75%	09/01/2029	38,097	35,871,369	0.2
Under Armour, Inc.	3.25%	06/15/2026	1,122	1,085,022	0.0
Walgreens Boots Alliance, Inc.	2.13%	11/20/2026	EUR 942	981,282	0.0
Walgreens Boots Alliance, Inc.	3.20%	04/15/2030	USD 329	264,921	0.0
Walgreens Boots Alliance, Inc.	3.45%	06/01/2026	959	913,436	0.0
White Cap Buyer LLC	6.88%	10/15/2028	20,518	20,320,793	0.1
				<u>498,582,523</u>	<u>3.0</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
AdaptHealth LLC	4.63%	08/01/2029	1,000	912,830	0.0
AdaptHealth LLC	5.13%	03/01/2030	24,648	22,529,726	0.1
AdaptHealth LLC	6.13%	08/01/2028	5,430	5,384,140	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	3.50%	03/15/2029	7,000	6,486,170	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	4.63%	01/15/2027	12,062	11,796,355	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	4.88%	02/15/2030	7,984	7,833,270	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	5.88%	02/15/2028	1,000	998,052	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	6.50%	02/15/2028	6,180	6,258,668	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	7.50%	03/15/2026	5,667	5,732,174	0.0
Amer Sports Co.	6.75%	02/16/2031	12,408	12,609,339	0.1
Bausch & Lomb Corp.	8.38%	10/01/2028	39,341	41,430,429	0.3
Bausch Health Cos., Inc.	5.75%	08/15/2027	3,938	3,097,752	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	6.25%	02/15/2029	9,519	4,897,579	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	7.25%	05/30/2029	12,447	6,347,491	0.0
Bayer AG	7.00%	09/25/2083	EUR 800	950,513	0.0
CAB SELAS	3.38%	02/01/2028	6,591	6,742,229	0.0
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	5.50%	01/15/2028	USD 4,371	4,211,245	0.0
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	7.50%	05/15/2030	EUR 5,250	6,053,345	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.	5.25%	05/15/2030	USD 1,000	896,289	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.	5.63%	03/15/2027	7,408	7,181,583	0.1
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.00%	01/15/2029	7,082	6,734,922	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.13%	04/01/2030	17,452	13,769,201	0.1
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.88%	04/01/2028	736	586,338	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.88%	04/15/2029	33,534	28,734,880	0.2
CHS/Community Health Systems, Inc.	10.88%	01/15/2032	3,707	4,015,356	0.0
DaVita, Inc.	3.75%	02/15/2031	6,153	5,479,095	0.0
DaVita, Inc.	4.63%	06/01/2030	57,774	54,373,218	0.3
Elanco Animal Health, Inc.	6.65%	08/28/2028	30,661	31,846,199	0.2
ELO SACA, Series E.	3.25%	07/23/2027	EUR 1,000	1,001,769	0.0
ELO SACA, Series E.	4.88%	12/08/2028	1,000	989,333	0.0
ELO SACA, Series E.	6.00%	03/22/2029	100	102,940	0.0
Embeckta Corp.	5.00%	02/15/2030	USD 25,700	23,185,914	0.2
Endo Finance Holdings, Inc.	8.50%	04/15/2031	16,940	17,992,752	0.1
Ephios Subco 3 SARL	7.88%	01/31/2031	EUR 4,400	5,205,836	0.0
Fortrea Holdings, Inc.	7.50%	07/01/2030	USD 32,768	33,458,510	0.2
Global Medical Response, Inc.(a)	10.00%	10/31/2028	16,985	16,950,883	0.1
Grifols SA	3.88%	10/15/2028	EUR 26,823	27,789,324	0.2
Grifols SA	4.75%	10/15/2028	USD 16,080	15,263,351	0.1
Gruenthal GmbH	6.75%	05/15/2030	EUR 5,295	6,193,402	0.0
Iceland Bondco PLC(b)	9.04%	12/15/2027	6,822	7,669,531	0.1
IQVIA, Inc.	6.50%	05/15/2030	USD 9,184	9,533,846	0.1
Lamb Weston Holdings, Inc.	4.13%	01/31/2030	3,000	2,792,770	0.0
Lamb Weston Holdings, Inc.	4.38%	01/31/2032	899	826,718	0.0
Legacy LifePoint Health LLC	4.38%	02/15/2027	1,000	976,376	0.0
LifePoint Health, Inc.	5.38%	01/15/2029	6,000	5,607,226	0.0
LifePoint Health, Inc.	9.88%	08/15/2030	1,000	1,098,318	0.0
Medline Borrower LP	3.88%	04/01/2029	25,280	23,908,057	0.2
Medline Borrower LP	5.25%	10/01/2029	40,404	39,722,565	0.3
ModivCare Escrow Issuer, Inc.	5.00%	10/01/2029	3,499	2,500,614	0.0
MPH Acquisition Holdings LLC	5.50%	09/01/2028	25,663	18,722,925	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC	5.75%	11/01/2028	52,764	24,202,052	0.2
Neogen Food Safety Corp.	8.63%	07/20/2030	13,872	15,112,574	0.1
Newell Brands, Inc.	6.38%	09/15/2027	3,906	3,934,047	0.0
Newell Brands, Inc.	6.63%	09/15/2029	16,113	16,116,220	0.1
Newell Brands, Inc.	6.88%	04/01/2036	549	522,545	0.0
Newell Brands, Inc.	7.00%	04/01/2046	1,323	1,143,490	0.0
Option Care Health, Inc.	4.38%	10/31/2029	21,312	20,244,983	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV.	2.88%	04/30/2028	EUR 1,200	\$ 1,262,987	0.0%
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV.	4.13%	04/30/2028	USD 11,341	10,837,210	0.1
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV.	5.13%	04/30/2031	35,341	33,065,680	0.2
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV.	6.75%	05/15/2034	8,064	8,375,290	0.1
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV.	7.88%	05/15/2034	3,636	3,837,349	0.0
Owens & Minor, Inc.	4.50%	03/31/2029	2,773	2,526,755	0.0
Owens & Minor, Inc.	6.63%	04/01/2030	10,162	9,837,294	0.1
Performance Food Group, Inc.	4.25%	08/01/2029	147	138,789	0.0
Perrigo Finance Unlimited Co.	4.38%	03/15/2026	3,248	3,185,923	0.0
Perrigo Finance Unlimited Co.	4.90%	06/15/2030	5,361	5,182,836	0.0
Post Holdings, Inc.	4.50%	09/15/2031	3,000	2,790,508	0.0
Post Holdings, Inc.	4.63%	04/15/2030	2,600	2,471,643	0.0
Post Holdings, Inc.	5.50%	12/15/2029	33,783	33,183,411	0.2
Post Holdings, Inc.	5.63%	01/15/2028	3,097	3,088,037	0.0
Post Holdings, Inc.	6.25%	02/15/2032	2,747	2,819,197	0.0
Primo Water Holdings, Inc.	4.38%	04/30/2029	6,889	6,527,842	0.0
Sotera Health Holdings LLC	7.38%	06/01/2031	21,478	22,475,194	0.1
Spectrum Brands, Inc.	3.88%	03/15/2031	3,278	2,922,929	0.0
Surgery Center Holdings, Inc.	7.25%	04/15/2032	16,507	17,354,411	0.1
Tenet Healthcare Corp.	4.25%	06/01/2029	1,149	1,103,296	0.0
Tenet Healthcare Corp.	4.38%	01/15/2030	20	19,137	0.0
Tenet Healthcare Corp.	4.63%	06/15/2028	216	211,270	0.0
Tenet Healthcare Corp.	6.13%	10/01/2028	3,049	3,061,174	0.0
Tenet Healthcare Corp.	6.13%	06/15/2030	11,559	11,765,274	0.1
Tenet Healthcare Corp.	6.25%	02/01/2027	5,000	5,011,329	0.0
Triton Water Holdings, Inc.	6.25%	04/01/2029	16,820	16,615,667	0.1
US Acute Care Solutions LLC.	9.75%	05/15/2029	1,036	1,060,988	0.0
US Foods, Inc.	4.63%	06/01/2030	10,566	10,103,822	0.1
US Foods, Inc.	4.75%	02/15/2029	141	137,477	0.0
US Foods, Inc.	6.88%	09/15/2028	127	132,176	0.0
				871,762,154	5.0
ENERGIE					
Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp. .	5.38%	06/15/2029	130	128,487	0.0
Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp. .	5.75%	03/01/2027	130	129,873	0.0
Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp. .	5.75%	01/15/2028	160	160,214	0.0
Berry Petroleum Co. LLC	7.00%	02/15/2026	9,146	9,056,927	0.1
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	7.00%	07/15/2029	8,862	9,220,756	0.1
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	7.25%	07/15/2032	5,416	5,690,767	0.0
Buckeye Partners LP	3.95%	12/01/2026	1,135	1,103,223	0.0
Buckeye Partners LP	4.13%	03/01/2025	715	709,411	0.0
Buckeye Partners LP	4.13%	12/01/2027	3,962	3,802,537	0.0
Buckeye Partners LP	4.50%	03/01/2028	302	290,521	0.0
Buckeye Partners LP	5.85%	11/15/2043	1,271	1,148,720	0.0
Buckeye Partners LP	6.88%	07/01/2029	29,436	30,161,254	0.2
CITGO Petroleum Corp.	6.38%	06/15/2026	11,351	11,410,322	0.1
CITGO Petroleum Corp.	7.00%	06/15/2025	37,747	37,806,584	0.2
CITGO Petroleum Corp.	8.38%	01/15/2029	1,117	1,160,391	0.0
Civitas Resources, Inc.	5.00%	10/15/2026	3,689	3,645,011	0.0
Civitas Resources, Inc.	8.38%	07/01/2028	18,949	20,014,351	0.1
Civitas Resources, Inc.	8.63%	11/01/2030	7,426	8,087,437	0.1
Civitas Resources, Inc.	8.75%	07/01/2031	17,420	18,823,656	0.1
CNX Resources Corp.	6.00%	01/15/2029	15,062	15,125,129	0.1
CNX Resources Corp.	7.25%	03/01/2032	8,400	8,810,690	0.1
CNX Resources Corp.	7.38%	01/15/2031	160	167,247	0.0
Comstock Resources, Inc.	5.88%	01/15/2030	3,578	3,385,062	0.0
Comstock Resources, Inc.	6.75%	03/01/2029	15,500	15,242,976	0.1
CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC	5.50%	06/15/2031	8,012	7,858,054	0.1
Crescent Energy Finance LLC.	7.38%	01/15/2033	10,881	11,172,239	0.1
Crescent Energy Finance LLC.	7.63%	04/01/2032	10,449	10,779,101	0.1
Crescent Energy Finance LLC.	9.25%	02/15/2028	8,423	8,913,401	0.1
Encino Acquisition Partners Holdings LLC	8.50%	05/01/2028	25,563	26,319,563	0.2
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	7.75%	02/01/2028	15,114	15,378,953	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	8.00%	01/15/2027	6,733	6,904,626	0.0
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	7.00%	08/01/2027	8,217	8,293,463	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	8.25%	01/15/2032	12,846	13,367,814	0.1
Gulfport Energy Corp.	8.00%	05/17/2026	69	70,596	0.0
Gulfport Energy Corp.	8.00%	05/17/2026	11,726	11,934,586	0.1
Hess Midstream Operations LP	4.25%	02/15/2030	8,834	8,353,741	0.1
Hess Midstream Operations LP	5.63%	02/15/2026	10,815	10,793,645	0.1
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	5.75%	02/01/2029	5,810	5,773,083	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	6.00%	02/01/2031	9,336	9,292,067	0.1
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	6.25%	04/15/2032	843	841,775	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	8.38%	11/01/2033	20,299	22,228,262	0.1
Howard Midstream Energy Partners LLC	7.38%	07/15/2032	7,711	7,978,546	0.1
Howard Midstream Energy Partners LLC	8.88%	07/15/2028	11,275	12,029,586	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ITT Holdings LLC	6.50%	08/01/2029	USD 37,941	\$ 35,853,564	0.2%
Kodiak Gas Services LLC	7.25%	02/15/2029	6,647	6,887,989	0.0
Moss Creek Resources Holdings, Inc.	8.25%	09/01/2031	21,749	21,917,137	0.1
Murphy Oil Corp.	5.88%	12/01/2042	700	637,995	0.0
Nabors Industries, Inc.	7.38%	05/15/2027	20,649	20,873,255	0.1
Nabors Industries, Inc.	9.13%	01/31/2030	14,585	15,651,190	0.1
New Fortress Energy, Inc.	6.50%	09/30/2026	32,092	27,700,946	0.2
New Fortress Energy, Inc.	6.75%	09/15/2025	14,623	14,261,861	0.1
New Fortress Energy, Inc.	8.75%	03/15/2029	20,410	17,100,125	0.1
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp.	8.13%	02/15/2029	20,447	20,919,566	0.1
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp.	8.38%	02/15/2032	48,447	49,905,245	0.3
NuStar Logistics LP	5.63%	04/28/2027	830	832,397	0.0
NuStar Logistics LP	5.75%	10/01/2025	130	130,075	0.0
NuStar Logistics LP	6.00%	06/01/2026	2,405	2,425,329	0.0
NuStar Logistics LP	6.38%	10/01/2030	5,271	5,512,275	0.0
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.	6.00%	02/15/2028	12,925	12,787,170	0.1
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.	7.88%	03/15/2030	12,209	12,712,242	0.1
Permian Resources Operating LLC	6.25%	02/01/2033	13,761	14,110,053	0.1
Rockies Express Pipeline LLC	4.95%	07/15/2029	1,142	1,093,859	0.0
Rockies Express Pipeline LLC	6.88%	04/15/2040	1,125	1,092,386	0.0
SM Energy Co.	6.63%	01/15/2027	2,000	2,005,413	0.0
SM Energy Co.	6.75%	09/15/2026	8,555	8,577,971	0.1
Solaris Midstream Holdings LLC	7.63%	04/01/2026	8,515	8,575,913	0.1
Southwestern Energy Co.	5.38%	02/01/2029	18,012	17,784,268	0.1
Southwestern Energy Co.	8.38%	09/15/2028	4,053	4,176,278	0.0
Summit Midstream Holdings LLC	8.63%	10/31/2029	8,364	8,683,998	0.1
Sunoco LP	7.00%	05/01/2029	3,735	3,892,747	0.0
Sunoco LP	7.25%	05/01/2032	4,093	4,331,325	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	4.50%	05/15/2029	2,678	2,572,668	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	4.50%	04/30/2030	1,612	1,534,420	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	5.88%	03/15/2028	26,261	26,303,431	0.2
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	7.00%	09/15/2028	127	132,222	0.0
Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp.	6.00%	12/31/2030	2,644	2,522,929	0.0
Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp.	6.00%	09/01/2031	1,151	1,091,192	0.0
Talos Production, Inc.	9.00%	02/01/2029	8,124	8,625,095	0.1
Talos Production, Inc.	9.38%	02/01/2031	10,683	11,405,937	0.1
Topaz Solar Farms LLC	5.75%	09/30/2039	46	45,035	0.0
Transocean Aquila Ltd.	8.00%	09/30/2028	18,419	18,947,156	0.1
Transocean Poseidon Ltd.	6.88%	02/01/2027	600	600,600	0.0
Transocean, Inc.	8.75%	02/15/2030	7,568	7,989,724	0.1
Venture Global Calcasieu Pass LLC	3.88%	08/15/2029	149	140,880	0.0
Venture Global Calcasieu Pass LLC	6.25%	01/15/2030	13,171	13,703,378	0.1
Venture Global LNG, Inc.	7.00%	01/15/2030	5,464	5,592,687	0.0
Venture Global LNG, Inc.	9.88%	02/01/2032	18,490	20,578,371	0.1
				<u>865,782,944</u>	<u>5.7</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
American Builders & Contractors Supply Co., Inc.	3.88%	11/15/2029	2,000	1,851,247	0.0
American Builders & Contractors Supply Co., Inc.	4.00%	01/15/2028	3,577	3,439,890	0.0
Belden, Inc.	3.38%	07/15/2031	EUR 19,101	19,681,458	0.1
Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC	8.00%	02/01/2028	USD 36,163	36,246,821	0.2
Fluor Corp.	4.25%	09/15/2028	60	58,156	0.0
Gates Corp./DE	6.88%	07/01/2029	3,558	3,653,690	0.0
Pachelbel Bidco SpA	7.13%	05/17/2031	EUR 12,822	14,881,856	0.1
Pachelbel Bidco SpA(b)	8.07%	05/17/2031	3,539	3,928,649	0.0
Resideo Funding, Inc.	6.50%	07/15/2032	USD 11,666	11,880,695	0.1
Ritchie Bros Holdings, Inc.	7.75%	03/15/2031	7,766	8,262,410	0.1
Velocity Vehicle Group LLC	8.00%	06/01/2029	15,000	15,594,103	0.1
				<u>119,478,975</u>	<u>0.7</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
ADT Security Corp. (The)	4.13%	08/01/2029	4,800	4,554,795	0.0
ADT Security Corp. (The)	4.88%	07/15/2032	3,011	2,866,702	0.0
Allied Universal Holdco LLC	7.88%	02/15/2031	9,700	9,845,896	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	6.00%	06/01/2029	13,593	12,097,770	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	9.75%	07/15/2027	20,978	21,002,408	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL	4.63%	06/01/2028	14,329	13,292,902	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL	4.63%	06/01/2028	6,384	5,915,671	0.0
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL	4.88%	06/01/2028	GBP 8,760	10,519,353	0.1
ANGI Group LLC	3.88%	08/15/2028	USD 16,913	15,309,770	0.1
APX Group, Inc.	5.75%	07/15/2029	20,401	20,239,336	0.1
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027	36,652	36,688,192	0.2
Aramark Services, Inc.	5.00%	02/01/2028	3,507	3,437,432	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Block, Inc.	3.50%	06/01/2031	USD 2,000	\$ 1,806,594	0.0%
Block, Inc.	6.50%	05/15/2032	23,289	24,171,366	0.2
Cars.com, Inc.	6.38%	11/01/2028	17,322	17,241,329	0.1
Garda World Security Corp.	4.63%	02/15/2027	16,910	16,487,668	0.1
Garda World Security Corp.	6.00%	06/01/2029	1,000	944,276	0.0
Garda World Security Corp.	7.75%	02/15/2028	5,598	5,850,552	0.0
Garda World Security Corp.	8.25%	08/01/2032	14,381	14,639,505	0.1
Garda World Security Corp.	9.50%	11/01/2027	16,407	16,500,496	0.1
Korn Ferry	4.63%	12/15/2027	17,280	16,831,304	0.1
Millennium Escrow Corp.	6.63%	08/01/2026	24,792	14,822,209	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	3.38%	08/31/2027	11,077	10,495,669	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.75%	04/15/2026	3,800	3,813,242	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	6.25%	01/15/2028	47,478	47,313,171	0.3
Q-Park Holding I BV	5.13%	02/15/2030	EUR 6,694	7,518,323	0.1
Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH	5.38%	07/15/2029	10,159	11,462,571	0.1
WASH Multifamily Acquisition, Inc.	5.75%	04/15/2026	USD 8,686	8,638,271	0.1
				<u>374,306,773</u>	<u>2.4</u>
TECHNOLOGIE					
Ahead DB Holdings LLC	6.63%	05/01/2028	21,260	20,406,194	0.1
Amentum Escrow Corp.	7.25%	08/01/2032	7,763	8,111,438	0.1
AthenaHealth Group, Inc.	6.50%	02/15/2030	32,294	30,889,252	0.2
Clarivate Science Holdings Corp.	4.88%	07/01/2029	1,800	1,733,385	0.0
Entegris, Inc.	5.95%	06/15/2030	15,018	15,213,039	0.1
Fortress Intermediate 3, Inc.	7.50%	06/01/2031	12,363	12,839,690	0.1
Gen Digital, Inc.	6.75%	09/30/2027	21,915	22,475,538	0.1
Gen Digital, Inc.	7.13%	09/30/2030	11,132	11,637,048	0.1
GoTo Group, Inc.	5.50%	05/01/2028	10,319	8,010,182	0.1
GoTo Group, Inc.	5.50%	05/01/2028	14,250	5,282,568	0.0
NCR Voyix Corp.	5.00%	10/01/2028	1,874	1,848,855	0.0
Playtika Holding Corp.	4.25%	03/15/2029	33,595	30,257,954	0.2
Rackspace Finance LLC	3.50%	05/15/2028	23,912	10,721,667	0.1
Rocket Software, Inc.	9.00%	11/28/2028	18,233	18,922,594	0.1
Science Applications International Corp.	4.88%	04/01/2028	2,738	2,660,114	0.0
Seagate HDD Cayman	4.09%	06/01/2029	25,862	24,617,231	0.2
Seagate HDD Cayman	4.88%	06/01/2027	11,014	10,973,568	0.1
Seagate HDD Cayman	8.25%	12/15/2029	4,834	5,243,756	0.0
Seagate HDD Cayman	8.50%	07/15/2031	5,125	5,576,471	0.0
Seagate HDD Cayman	9.63%	12/01/2032	754	869,700	0.0
TeamSystem SpA(b)	7.44%	02/15/2028	EUR 4,600	5,109,406	0.0
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.	7.50%	09/01/2025	USD 54,292	49,555,082	0.3
Virtusa Corp.	7.13%	12/15/2028	20,904	19,756,480	0.1
Western Digital Corp.	4.75%	02/15/2026	14,808	14,668,816	0.1
				<u>337,380,028</u>	<u>2.1</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Allegiant Travel Co.	7.25%	08/15/2027	9,196	8,746,019	0.1
American Airlines, Inc.	7.25%	02/15/2028	15,363	15,460,315	0.1
American Airlines, Inc.	8.50%	05/15/2029	79	82,109	0.0
American Airlines, Inc./AAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.50%	04/20/2026	22,393	22,270,505	0.1
American Airlines, Inc./AAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.75%	04/20/2029	20,390	20,005,004	0.1
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd./ HawaiianMiles Loyalty Ltd.	11.00%	04/15/2029	21,740	22,114,219	0.1
JetBlue Airways Corp./JetBlue Loyalty LP.	9.88%	09/20/2031	45,975	45,285,375	0.3
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.	8.00%	09/20/2025	17,117	10,664,700	0.1
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.	8.00%	09/20/2025	12,959	8,098,333	0.1
United Airlines, Inc.	4.38%	04/15/2026	254	248,103	0.0
United Airlines, Inc.	4.63%	04/15/2029	5,072	4,829,779	0.0
				<u>157,804,461</u>	<u>1.0</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Albion Financing 1 SARL/Aggreko Holdings, Inc.	6.13%	10/15/2026	17,353	17,237,979	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.38%	03/01/2029	12,256	11,261,909	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.75%	07/15/2027	31,510	30,631,585	0.2
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.75%	07/15/2027	1,653	1,611,140	0.0
Avis Budget Finance PLC	7.25%	07/31/2030	EUR 1,376	1,513,425	0.0
Boels Topholding BV.	5.75%	05/15/2030	11,700	13,279,937	0.1
Hertz Corp. (The)	4.63%	12/01/2026	USD 28,968	22,734,711	0.1
Hertz Corp. (The)	5.00%	12/01/2029	31,680	21,260,719	0.1
Hertz Corp. (The)	12.63%	07/15/2029	6,495	6,930,749	0.0
Loxam SAS	6.38%	05/31/2029	EUR 1,570	1,820,452	0.0
Mundys SpA.	1.88%	02/12/2028	1,046	1,079,647	0.0
Mundys SpA, Series E.	1.88%	07/13/2027	864	907,151	0.0
Mundys SpA, Series E.	4.75%	01/24/2029	162	184,042	0.0
PROG Holdings, Inc.	6.00%	11/15/2029	USD 14,711	14,358,981	0.1
United Rentals North America, Inc.	6.13%	03/15/2034	117	119,497	0.0
				<u>144,931,924</u>	<u>0.8</u>
				<u>6,655,026,948</u>	<u>40.7</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Ally Financial, Inc., Series C(d)	4.70%	05/15/2028	USD 16,427	\$ 13,734,914	0.1%
Bread Financial Holdings, Inc.	7.00%	01/15/2026	1,774	1,775,120	0.0
Bread Financial Holdings, Inc.	9.75%	03/15/2029	35,014	37,801,836	0.2
Synchrony Financial	7.25%	02/02/2033	2,511	2,598,463	0.0
UniCredit SpA	5.46%	06/30/2035	9,874	9,683,737	0.1
				<u>65,594,070</u>	<u>0.4</u>
MAKLER					
AG Issuer LLC	6.25%	03/01/2028	15,873	15,457,281	0.1
AG TTMT Escrow Issuer LLC	8.63%	09/30/2027	13,955	14,425,212	0.1
Aretec Group, Inc.	7.50%	04/01/2029	13,286	12,588,677	0.1
Aretec Group, Inc.	10.00%	08/15/2030	39,350	42,490,414	0.3
Hightower Holding LLC	6.75%	04/15/2029	27,389	26,087,951	0.2
Hightower Holding LLC	9.13%	01/31/2030	3,585	3,704,568	0.0
Osaic Holdings, Inc.	10.75%	08/01/2027	27,269	27,911,185	0.2
VFH Parent LLC/Valor Co-Issuer, Inc.	7.50%	06/15/2031	24,493	25,459,796	0.2
				<u>168,125,084</u>	<u>1.2</u>
FINANZEN					
Castlelake Aviation Finance DAC	5.00%	04/15/2027	10,857	10,599,537	0.1
CNG Holdings, Inc.	14.50%	06/30/2026	15,722	13,049,260	0.1
Compass Group Diversified Holdings LLC	5.25%	04/15/2029	23,935	23,224,758	0.2
Enova International, Inc.	9.13%	08/01/2029	26,229	26,627,010	0.2
Enova International, Inc.	11.25%	12/15/2028	14,408	15,498,012	0.1
GGAM Finance Ltd.	7.75%	05/15/2026	13,445	13,790,626	0.1
GGAM Finance Ltd.	8.00%	02/15/2027	10,026	10,456,471	0.1
GGAM Finance Ltd.	8.00%	06/15/2028	20,290	21,696,447	0.1
goeasy Ltd.	7.63%	07/01/2029	25,371	26,151,833	0.2
goeasy Ltd.	9.25%	12/01/2028	17,536	18,865,241	0.1
Jefferies Finance LLC/JFIN Co-Issuer Corp.	5.00%	08/15/2028	46,837	44,498,543	0.3
Navient Corp.	4.88%	03/15/2028	12,987	12,373,724	0.1
Navient Corp.	5.00%	03/15/2027	9,095	8,910,794	0.1
Navient Corp.	5.50%	03/15/2029	5,430	5,164,450	0.0
Navient Corp.	5.63%	08/01/2033	292	251,730	0.0
Navient Corp.	5.88%	10/25/2024	1,000	999,003	0.0
Navient Corp.	6.75%	06/25/2025	9,594	9,626,020	0.1
Navient Corp.	6.75%	06/15/2026	8,393	8,540,588	0.1
Navient Corp.	9.38%	07/25/2030	1,005	1,090,239	0.0
Navient Corp.	11.50%	03/15/2031	88	98,863	0.0
SLM Corp.	3.13%	11/02/2026	4,727	4,525,216	0.0
				<u>276,038,365</u>	<u>2.0</u>
VERSICHERUNGEN					
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	4.25%	02/15/2029	2,150	2,011,499	0.0
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	6.00%	08/01/2029	2,239	2,138,156	0.0
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	7.50%	11/06/2030	7,161	7,361,492	0.1
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	8.25%	02/01/2029	15,922	16,372,177	0.1
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	8.50%	06/15/2029	17,945	18,666,868	0.1
AmWINS Group, Inc.	6.38%	02/15/2029	5,893	6,040,150	0.0
Ardonagh Finco Ltd.	6.88%	02/15/2031	EUR 6,216	6,912,997	0.0
Ardonagh Finco Ltd.	6.88%	02/15/2031	3,000	3,336,388	0.0
Ardonagh Finco Ltd.	7.75%	02/15/2031	USD 9,601	9,911,385	0.1
Ardonagh Group Finance Ltd.	8.88%	02/15/2032	6,943	7,192,952	0.1
AssuredPartners, Inc.	5.63%	01/15/2029	17,645	16,861,091	0.1
Howden UK Refinance PLC/Howden UK Refinance 2 PLC/ Howden US Refinance LLC	7.25%	02/15/2031	7,937	8,182,408	0.1
Howden UK Refinance PLC/Howden UK Refinance 2 PLC/ Howden US Refinance LLC	8.13%	02/15/2032	2,756	2,804,402	0.0
HUB International Ltd.	7.25%	06/15/2030	23,088	24,148,065	0.2
HUB International Ltd.	7.38%	01/31/2032	8,599	8,920,801	0.1
Panther Escrow Issuer LLC	7.13%	06/01/2031	17,991	18,741,925	0.1
				<u>159,602,756</u>	<u>1.1</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
Armor Holdco, Inc.	8.50%	11/15/2029	31,547	30,176,614	0.2
Coinbase Global, Inc.	3.63%	10/01/2031	22,357	18,381,493	0.1
Encore Capital Group, Inc.	8.50%	05/15/2030	8,311	8,701,082	0.1
Encore Capital Group, Inc.	9.25%	04/01/2029	30,140	32,130,038	0.2
				<u>89,389,227</u>	<u>0.6</u>
REITs					
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	4.50%	04/01/2027	23,012	22,230,784	0.1
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	5.75%	05/15/2026	7,722	7,699,894	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Five Point Operating Co. LP/Five Point Capital Corp.	10.50%	01/15/2028	USD 20,733	\$ 21,300,529	0.1%
Heimstaden Bostad AB, Series E(d)	3.63%	10/13/2026	EUR 355	313,443	0.0
Hudson Pacific Properties LP	4.65%	04/01/2029	USD 1,184	981,588	0.0
Hudson Pacific Properties LP	5.95%	02/15/2028	868	777,963	0.0
Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2027	1,293	1,269,086	0.0
Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2029	23,788	23,093,869	0.1
Iron Mountain, Inc.	5.00%	07/15/2028	10,641	10,421,758	0.1
Iron Mountain, Inc.	5.25%	03/15/2028	2,653	2,623,218	0.0
Iron Mountain, Inc.	5.25%	07/15/2030	130	126,695	0.0
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd., Series E	3.25%	11/12/2025	EUR 1,100	1,165,263	0.0
Service Properties Trust	4.38%	02/15/2030	USD 112	82,758	0.0
Service Properties Trust	5.50%	12/15/2027	1,000	940,436	0.0
Service Properties Trust	8.38%	06/15/2029	18,885	18,666,308	0.1
Service Properties Trust	8.63%	11/15/2031	17,241	18,403,931	0.1
Service Properties Trust	8.88%	06/15/2032	1,141	1,076,360	0.0
Vivion Investments SARL, Series E(a)	7.90%	08/31/2028	EUR 80	82,236	0.0
Vivion Investments SARL, Series E(a)	7.90%	02/28/2029	2	1,935	0.0
				<u>131,258,054</u>	<u>0.7</u>
				<u>890,007,556</u>	<u>6.0</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
AES Andes SA	8.15%	06/10/2055	USD 4,936	5,058,737	0.0
Elia Group SA/NV(d)	5.85%	03/15/2028	EUR 800	922,093	0.0
Lightning Power LLC	7.25%	08/15/2032	USD 19,156	19,794,725	0.1
NRG Energy, Inc.	3.38%	02/15/2029	5,953	5,468,145	0.0
NRG Energy, Inc.	3.63%	02/15/2031	1,150	1,031,831	0.0
NRG Energy, Inc.	3.88%	02/15/2032	2,548	2,286,232	0.0
NRG Energy, Inc.	5.25%	06/15/2029	130	128,791	0.0
NRG Energy, Inc.	6.63%	01/15/2027	334	334,143	0.0
Vistra Operations Co. LLC	4.38%	05/01/2029	945	905,267	0.0
Vistra Operations Co. LLC	5.00%	07/31/2027	130	128,676	0.0
Vistra Operations Co. LLC	5.63%	02/15/2027	130	129,823	0.0
				<u>36,188,463</u>	<u>0.1</u>
ERDGAS					
AmeriGas Partners LP/AmeriGas Finance Corp.	5.75%	05/20/2027	3,071	3,005,456	0.0
AmeriGas Partners LP/AmeriGas Finance Corp.	5.88%	08/20/2026	2,288	2,263,647	0.0
				<u>5,269,103</u>	<u>0.0</u>
				<u>41,457,566</u>	<u>0.1</u>
				<u>7,586,492,070</u>	<u>46.8</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
AngloGold Ashanti Holdings PLC	3.38%	11/01/2028	7,504	6,964,688	0.0
ArcelorMittal SA	6.75%	03/01/2041	14,025	15,017,311	0.1
Celanese US Holdings LLC	6.55%	11/15/2030	15,079	16,177,743	0.1
CF Industries, Inc.	4.95%	06/01/2043	8,883	8,141,592	0.1
CF Industries, Inc.	5.15%	03/15/2034	11,669	11,624,170	0.1
CF Industries, Inc.	5.38%	03/15/2044	14,106	13,558,961	0.1
Equate Sukuk Spc Ltd.	5.00%	09/05/2031	8,090	8,008,696	0.0
Glencore Funding LLC	5.63%	04/04/2034	27,829	28,332,051	0.2
Glencore Funding LLC	5.70%	05/08/2033	13,626	14,033,639	0.1
Glencore Funding LLC	6.50%	10/06/2033	18,924	20,430,289	0.1
Olin Corp.	5.00%	02/01/2030	3,728	3,604,790	0.0
Olin Corp.	5.63%	08/01/2029	7,317	7,288,982	0.1
Sealed Air Corp.	1.57%	10/15/2026	1,070	995,240	0.0
				<u>154,178,152</u>	<u>1.0</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Boeing Co. (The)	3.25%	02/01/2028	11,931	11,240,751	0.1
Boeing Co. (The)	3.63%	02/01/2031	9,232	8,362,953	0.1
Boeing Co. (The)	5.15%	05/01/2030	8,064	8,042,807	0.1
Boeing Co. (The)	6.53%	05/01/2034	24,730	26,206,739	0.2
Wabtec Transportation Netherlands BV	1.25%	12/03/2027	EUR 100	103,865	0.0
				<u>53,957,115</u>	<u>0.5</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Charter Communications Operating LLC/ Charter Communications Operating Capital	6.10%	06/01/2029	USD 3,820	3,945,859	0.0
DIRECTV Financing LLC	8.88%	02/01/2030	21,654	21,976,603	0.1
DIRECTV Financing LLC/Directv Financing Co-Obligor, Inc.	5.88%	08/15/2027	38,431	37,204,665	0.2
Paramount Global	4.20%	06/01/2029	2,665	2,504,861	0.0
Paramount Global	4.20%	05/19/2032	7,852	6,825,811	0.0
Paramount Global	4.95%	01/15/2031	5,337	4,967,694	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Paramount Global	5.50%	05/15/2033	USD 4,813	\$ 4,419,104	0.0%
Paramount Global	6.88%	04/30/2036	5,341	5,334,671	0.0
Paramount Global	7.88%	07/30/2030	8,538	9,281,076	0.1
Time Warner Cable LLC	6.55%	05/01/2037	720	711,624	0.0
Time Warner Cable LLC	6.75%	06/15/2039	30	29,754	0.0
Time Warner Cable LLC	7.30%	07/01/2038	98	102,949	0.0
Warnermedia Holdings, Inc.	3.76%	03/15/2027	11,000	10,538,237	0.1
Warnermedia Holdings, Inc.	4.28%	03/15/2032	20,000	17,485,121	0.1
				<u>125,328,029</u>	<u>0.6</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
SES GLOBAL Americas Holdings, Inc.	5.30%	03/25/2044	627	493,008	0.0
Sprint Capital Corp.	8.75%	03/15/2032	455	560,536	0.0
Sprint LLC	7.63%	02/15/2025	3,000	3,010,985	0.0
Sprint LLC	7.63%	03/01/2026	8,328	8,589,431	0.1
Vodafone International Financing DAC, Series E	4.00%	02/10/2043	EUR 100	111,008	0.0
				<u>12,764,968</u>	<u>0.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Adient Global Holdings Ltd.	7.00%	04/15/2028	USD 5,300	5,441,702	0.0
Ford Motor Co.	3.25%	02/12/2032	73,565	62,744,837	0.4
Ford Motor Credit Co. LLC	2.90%	02/16/2028	2,064	1,909,754	0.0
Ford Motor Credit Co. LLC	6.13%	03/08/2034	9,442	9,560,158	0.1
Ford Motor Credit Co. LLC	7.35%	03/06/2030	258	279,388	0.0
General Motors Co.	6.25%	10/02/2043	2,398	2,494,534	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	5.65%	01/17/2029	11,876	12,211,129	0.1
General Motors Financial Co., Inc.	5.75%	02/08/2031	11,638	12,016,875	0.1
General Motors Financial Co., Inc.	5.95%	04/04/2034	2,331	2,413,385	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	6.40%	01/09/2033	39,978	42,862,988	0.3
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.05%	02/14/2027	7,763	7,425,623	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	5.95%	06/11/2029	26,377	26,970,795	0.2
Hyundai Capital America	2.00%	06/15/2028	8,597	7,796,109	0.1
Hyundai Capital America	5.30%	01/08/2029	7,329	7,472,792	0.1
Hyundai Capital America	6.20%	09/21/2030	7,751	8,288,717	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.50%	07/15/2029	10,597	10,570,910	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	01/15/2028	14,183	14,223,170	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	7.75%	10/15/2025	24,649	24,757,810	0.2
Lear Corp.	3.50%	05/30/2030	12,304	11,473,371	0.1
Nissan Motor Acceptance Co. LLC	1.85%	09/16/2026	1,433	1,335,710	0.0
Nissan Motor Acceptance Co. LLC	2.45%	09/15/2028	20,290	18,027,762	0.1
Nissan Motor Acceptance Co. LLC	2.75%	03/09/2028	18,160	16,543,765	0.1
Nissan Motor Co., Ltd.	4.35%	09/17/2027	647	627,768	0.0
Nissan Motor Co., Ltd.	4.81%	09/17/2030	7,270	6,874,535	0.0
RCI Banque SA	4.13%	04/04/2031	EUR 62	69,355	0.0
RCI Banque SA, Series E	1.13%	01/15/2027	1,006	1,061,891	0.0
RCI Banque SA, Series E	1.63%	05/26/2026	37	39,824	0.0
RCI Banque SA, Series E	4.50%	04/06/2027	903	1,023,330	0.0
RCI Banque SA, Series E	4.88%	06/14/2028	26	30,047	0.0
RCI Banque SA, Series E	4.88%	09/21/2028	34	39,376	0.0
Schaeffler AG, Series E	2.75%	10/12/2025	400	437,264	0.0
Schaeffler AG, Series E	3.38%	10/12/2028	1,000	1,083,022	0.0
Schaeffler AG, Series E	4.75%	08/14/2029	200	226,099	0.0
Valeo SE, Series E	1.00%	08/03/2028	1,100	1,078,065	0.0
Valeo SE, Series E	4.50%	04/11/2030	100	110,249	0.0
Valeo SE, Series E	5.38%	05/28/2027	300	343,309	0.0
Valeo SE, Series E	5.88%	04/12/2029	100	117,831	0.0
				<u>319,983,249</u>	<u>2.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	4.00%	08/01/2028	USD 16,360	15,579,312	0.1
Carnival Corp.	7.00%	08/15/2029	6,362	6,677,237	0.0
Hasbro, Inc.	6.05%	05/14/2034	10,349	10,724,324	0.1
Mattel, Inc.	5.88%	12/15/2027	3,598	3,638,068	0.0
				<u>36,618,941</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Flutter Treasury Designated Activity Co.	5.00%	04/29/2029	EUR 3,974	4,498,809	0.0
Flutter Treasury Designated Activity Co.	6.38%	04/29/2029	USD 2,019	2,080,126	0.0
International Game Technology PLC	5.25%	01/15/2029	512	504,939	0.0
International Game Technology PLC	6.25%	01/15/2027	9,125	9,269,895	0.1
International Game Technology PLC	6.50%	02/15/2025	5,260	5,262,904	0.0
Las Vegas Sands Corp.	3.90%	08/08/2029	864	808,980	0.0
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	31,126	32,717,857	0.2
Owens Corning	7.00%	12/01/2036	2,898	3,350,963	0.0
PulteGroup, Inc.	6.00%	02/15/2035	615	657,121	0.0
PulteGroup, Inc.	6.38%	05/15/2033	24,025	26,134,319	0.2
PulteGroup, Inc.	7.88%	06/15/2032	16,167	19,072,938	0.1
Resorts World Las Vegas LLC/RWLV Capital, Inc.	4.63%	04/16/2029	9,800	8,819,675	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Resorts World Las Vegas LLC/RWLV Capital, Inc.	8.45%	07/27/2030	USD 14,800	\$ 15,658,876	0.1%
Sands China Ltd.	2.85%	03/08/2029	5,672	5,078,361	0.0
Sands China Ltd.	3.25%	08/08/2031	1,319	1,140,671	0.0
Sands China Ltd.	4.38%	06/18/2030	4,444	4,190,110	0.0
Sands China Ltd.	5.40%	08/08/2028	16,900	16,859,440	0.1
				<u>156,105,984</u>	<u>0.9</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Macy's Retail Holdings LLC	5.88%	04/01/2029	5,457	5,327,334	0.0
Macy's Retail Holdings LLC	5.88%	03/15/2030	8,853	8,589,367	0.1
Macy's Retail Holdings LLC	6.13%	03/15/2032	3,274	3,135,132	0.0
Tapestry, Inc.	7.00%	11/27/2026	14,445	14,903,313	0.1
				<u>31,955,146</u>	<u>0.2</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Altria Group, Inc.	6.88%	11/01/2033	16,428	18,400,958	0.1
BAT Capital Corp.	6.00%	02/20/2034	8,983	9,471,751	0.1
BAT Capital Corp.	6.42%	08/02/2033	10,590	11,467,565	0.1
Bayer AG	1.13%	01/06/2030	EUR 300	292,037	0.0
Bayer AG, Series E	4.63%	05/26/2033	138	159,852	0.0
Charles River Laboratories International, Inc.	3.75%	03/15/2029	USD 1,822	1,708,961	0.0
Charles River Laboratories International, Inc.	4.00%	03/15/2031	700	644,371	0.0
Charles River Laboratories International, Inc.	4.25%	05/01/2028	373	360,279	0.0
Coty, Inc./HFC Prestige Products, Inc./ HFC Prestige International US LLC	4.75%	01/15/2029	2,000	1,944,636	0.0
CVS Health Corp.	5.70%	06/01/2034	20,121	20,608,442	0.1
HCA, Inc.	3.63%	03/15/2032	9,307	8,461,453	0.1
Imperial Brands Finance PLC	3.88%	07/26/2029	1,800	1,717,593	0.0
Imperial Brands Finance PLC	5.88%	07/01/2034	16,307	16,707,676	0.1
IQVIA, Inc.	6.25%	02/01/2029	14,765	15,600,974	0.1
Jazz Securities DAC	4.38%	01/15/2029	1,000	952,888	0.0
JBS USA Holding Lux Sarl/JBS USA Food Co/ JBS Lux Co. SARL	6.75%	03/15/2034	19,956	21,917,979	0.1
Pilgrim's Pride Corp.	6.88%	05/15/2034	25,519	28,161,885	0.2
				<u>158,579,300</u>	<u>1.0</u>
ENERGIE					
Antero Resources Corp.	7.63%	02/01/2029	1,453	1,505,496	0.0
Apache Corp.	4.25%	01/15/2030	10,000	9,554,223	0.1
Canadian Natural Resources Ltd.	6.25%	03/15/2038	19	20,249	0.0
Canadian Natural Resources Ltd.	6.50%	02/15/2037	743	801,678	0.0
Canadian Natural Resources Ltd.	6.75%	02/01/2039	17	18,828	0.0
Columbia Pipelines Operating Co. LLC	6.04%	11/15/2033	5,169	5,456,936	0.0
Continental Resources, Inc./OK	2.88%	04/01/2032	6,611	5,563,458	0.0
Continental Resources, Inc./OK	5.75%	01/15/2031	23,059	23,392,102	0.1
Energy Transfer LP	5.60%	09/01/2034	21,365	21,950,577	0.1
Energy Transfer LP	8.00%	05/15/2054	2,000	2,129,112	0.0
Energy Transfer LP	8.25%	11/15/2029	8,521	9,792,252	0.1
Energy Transfer LP, Series 20Y	5.80%	06/15/2038	714	731,926	0.0
EnLink Midstream LLC.	5.63%	01/15/2028	22,047	22,458,204	0.1
EnLink Midstream LLC.	6.50%	09/01/2030	14,570	15,571,816	0.1
EnLink Midstream Partners LP	4.15%	06/01/2025	663	654,935	0.0
EnLink Midstream Partners LP	5.05%	04/01/2045	12,856	11,273,253	0.1
EnLink Midstream Partners LP	5.45%	06/01/2047	8,848	8,124,895	0.1
EnLink Midstream Partners LP	5.60%	04/01/2044	10,151	9,491,893	0.1
Enterprise Products Operating LLC.	5.38%	02/15/2078	389	365,531	0.0
EQM Midstream Partners LP.	4.50%	01/15/2029	2,248	2,178,923	0.0
EQM Midstream Partners LP.	4.75%	01/15/2031	2,740	2,639,829	0.0
EQM Midstream Partners LP.	5.50%	07/15/2028	135	136,086	0.0
EQM Midstream Partners LP.	6.38%	04/01/2029	5,320	5,467,467	0.0
EQM Midstream Partners LP.	6.50%	07/01/2027	984	1,009,391	0.0
EQM Midstream Partners LP.	6.50%	07/15/2048	733	757,305	0.0
EQM Midstream Partners LP.	7.50%	06/01/2027	969	999,630	0.0
EQM Midstream Partners LP.	7.50%	06/01/2030	10,000	10,916,419	0.1
EQT Corp.	3.90%	10/01/2027	10,000	9,772,524	0.1
EQT Corp.	5.75%	02/01/2034	8,229	8,381,266	0.1
Hess Corp.	7.30%	08/15/2031	2,953	3,368,903	0.0
Kinder Morgan Energy Partners LP.	6.55%	09/15/2040	139	148,945	0.0
Kinder Morgan, Inc., Series G.	7.75%	01/15/2032	4,518	5,240,145	0.0
Kinder Morgan, Inc., Series G.	7.80%	08/01/2031	20,733	23,954,167	0.2
Northern Natural Gas Co.	3.40%	10/16/2051	1,468	1,013,673	0.0
Northern Natural Gas Co.	4.30%	01/15/2049	88	72,235	0.0
Occidental Petroleum Corp.	5.20%	08/01/2029	15,507	15,732,725	0.1
Occidental Petroleum Corp.	5.38%	01/01/2032	16,134	16,353,331	0.1
Occidental Petroleum Corp.	5.50%	12/01/2025	5,236	5,268,996	0.0
Occidental Petroleum Corp.	5.88%	09/01/2025	4,883	4,914,492	0.0
ONEOK, Inc.	6.05%	09/01/2033	11,276	11,911,729	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Targa Resources Corp.	4.20%	02/01/2033	USD 2,008	\$ 1,870,820	0.0%
Var Energi ASA	5.00%	05/18/2027	4,700	4,690,521	0.0
Var Energi ASA, Series E	5.50%	05/04/2029	EUR 615	725,692	0.0
Western Midstream Operating LP	3.10%	02/01/2025	USD 12,908	12,769,780	0.1
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025	3,698	3,656,261	0.0
Western Midstream Operating LP	5.45%	04/01/2044	5,469	5,069,381	0.0
				<u>307,878,000</u>	<u>1.8</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
LKQ Corp.	5.75%	06/15/2028	17,210	17,724,299	0.1
LKQ Corp.	6.25%	06/15/2033	15,258	16,039,493	0.1
Ritchie Bros Holdings, Inc.	6.75%	03/15/2028	8,396	8,649,340	0.1
				<u>42,413,132</u>	<u>0.3</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Boost Newco Borrower LLC	7.50%	01/15/2031	19,964	21,302,250	0.1
Boost Newco Borrower LLC/GTCR W Dutch Finance Sub BV	8.50%	01/15/2031	GBP 4,484	6,359,591	0.0
				<u>27,661,841</u>	<u>0.1</u>
TECHNOLOGIE					
Dell International LLC/EMC Corp.	5.85%	07/15/2025	USD 9,315	9,372,843	0.1
Entegris, Inc.	4.75%	04/15/2029	10,000	9,801,648	0.1
Jabil, Inc.	3.00%	01/15/2031	1,800	1,585,070	0.0
Western Digital Corp.	2.85%	02/01/2029	3,902	3,497,720	0.0
Western Digital Corp.	3.10%	02/01/2032	5,432	4,569,512	0.0
				<u>28,826,793</u>	<u>0.2</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Air Canada	3.88%	08/15/2026	16,507	15,938,508	0.1
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.75%	10/20/2028	17,879	17,721,111	0.1
Mileage Plus Holdings LLC/ Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd.	6.50%	06/20/2027	30,176	30,450,630	0.2
Wizz Air Finance Co. BV, Series E	1.00%	01/19/2026	EUR 1,130	1,182,352	0.0
				<u>65,292,601</u>	<u>0.4</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
AerCap Global Aviation Trust	6.50%	06/15/2045	USD 14,021	13,994,710	0.1
				<u>1,535,537,961</u>	<u>9.7</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Abanca Corp. Bancaria SA, Series E	5.25%	09/14/2028	EUR 300	347,620	0.0
AIB Group PLC	6.61%	09/13/2029	USD 4,716	5,008,382	0.0
Ally Financial, Inc.	6.85%	01/03/2030	9,815	10,383,660	0.1
Ally Financial, Inc.	8.00%	11/01/2031	20,766	23,652,556	0.2
Ally Financial, Inc.	8.00%	11/01/2031	21,085	24,078,569	0.2
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	4.63%	01/13/2031	EUR 400	464,738	0.0
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	6.03%	03/13/2035	USD 21,000	21,927,500	0.1
Banco BPM SpA, Series E	4.88%	01/18/2027	EUR 570	651,853	0.0
Banco de Sabadell SA, Series E	5.13%	11/10/2028	700	814,029	0.0
Banco Santander SA	6.35%	03/14/2034	USD 16,000	16,822,263	0.1
Banco Santander SA	6.92%	08/08/2033	29,000	31,558,097	0.2
Banco Santander SA(d)	9.63%	05/21/2033	21,600	25,071,844	0.2
Bank Leumi Le-Israel BM	7.13%	07/18/2033	7,189	7,165,610	0.0
Bank of America Corp., Series B	8.05%	06/15/2027	32,004	34,532,613	0.2
Bank of America Corp., Series X(d)	6.25%	09/05/2024	4,224	4,224,000	0.0
Bank of Ireland Group PLC	5.60%	03/20/2030	13,166	13,501,289	0.1
Bank of Ireland Group PLC, Series E	0.38%	05/10/2027	EUR 778	819,607	0.0
Bank of New York Mellon Corp. (The)	5.61%	07/21/2039	USD 7,002	7,266,690	0.1
Bankinter SA	4.88%	09/13/2031	EUR 200	234,104	0.0
Barclays PLC	5.69%	03/12/2030	USD 3,609	3,724,512	0.0
Barclays PLC(d)	6.13%	12/15/2025	35,377	35,068,598	0.2
Barclays PLC	7.12%	06/27/2034	13,464	14,830,847	0.1
Barclays PLC(d)	7.13%	06/15/2025	GBP 6,422	8,434,849	0.1
Barclays PLC(d)	8.88%	09/15/2027	7,438	10,112,225	0.1
BNP Paribas SA(d)	4.63%	02/25/2031	USD 12,086	10,339,265	0.1
BPCE SA	4.88%	04/01/2026	3,000	2,980,386	0.0
BPCE SA	6.51%	01/18/2035	20,045	20,944,675	0.1
BPCE SA, Series E	0.75%	03/03/2031	EUR 11,100	10,255,432	0.1
BPCE SA, Series E	4.13%	03/08/2033	2,400	2,706,112	0.0
CaixaBank SA(d)	5.88%	10/09/2027	200	221,022	0.0
CaixaBank SA	6.04%	06/15/2035	USD 12,696	13,264,756	0.1
CaixaBank SA	6.84%	09/13/2034	19,641	21,643,194	0.1
CaixaBank SA, Series E	5.13%	07/19/2034	EUR 600	721,401	0.0
Capital One Financial Corp.	5.46%	07/26/2030	USD 15,529	15,801,001	0.1
Capital One Financial Corp.	5.82%	02/01/2034	17,444	17,820,856	0.1
Capital One Financial Corp.	6.05%	02/01/2035	7,098	7,366,817	0.1
Capital One Financial Corp.	6.38%	06/08/2034	20,449	21,706,733	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Capital One Financial Corp.	7.62%	10/30/2031	USD 10,847	\$ 12,243,640	0.1%
Citigroup, Inc.	5.83%	02/13/2035	22,259	22,881,985	0.1
Citigroup, Inc.	6.17%	05/25/2034	559	589,839	0.0
Citigroup, Inc., Series AA(d)	7.63%	11/15/2028	5,424	5,737,057	0.0
Citigroup, Inc., Series V(d)	4.70%	01/30/2025	8,408	8,343,604	0.1
Citigroup, Inc., Series W(d)	4.00%	12/10/2025	7,221	7,012,888	0.0
Citigroup, Inc., Series X(d)	3.88%	02/18/2026	8,826	8,463,083	0.1
Citigroup, Inc., Series Y(d)	4.15%	11/15/2026	14,900	14,108,730	0.1
Citizens Financial Group, Inc., Series B(d) (e)	8.58%	10/06/2024	8,895	8,830,790	0.1
Commerzbank AG	3.00%	09/14/2027	EUR 1,000	1,095,579	0.0
Commerzbank AG, Series E	5.13%	01/18/2030	1,000	1,170,178	0.0
Cooperatieve Rabobank UA(d)	3.25%	12/29/2026	23,200	24,038,506	0.2
Cooperatieve Rabobank UA(d)	4.38%	06/29/2027	18,800	20,197,056	0.1
Credit Agricole SA, Series E(d)	7.25%	09/23/2028	6,000	7,014,247	0.0
Deutsche Bank AG.	1.38%	02/17/2032	100	94,372	0.0
Deutsche Bank AG, Series E	6.13%	12/12/2030	GBP 400	539,548	0.0
Deutsche Bank AG/New York NY.	3.73%	01/14/2032	USD 204	180,617	0.0
Deutsche Bank AG/New York NY.	3.74%	01/07/2033	200	172,005	0.0
Deutsche Bank AG/New York NY.	6.82%	11/20/2029	9,155	9,758,132	0.1
Deutsche Bank AG/New York NY.	7.15%	07/13/2027	22,622	23,476,609	0.2
Dresdner Funding Trust I.	8.15%	06/30/2031	1,073	1,180,219	0.0
Dresdner Funding Trust I.	8.15%	06/30/2031	4,100	4,509,692	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	2.62%	04/22/2032	2,913	2,532,100	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	2.65%	10/21/2032	2,457	2,120,188	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(b) (d)	8.24%	09/30/2024	14,626	14,652,535	0.1
HSBC Holdings PLC	4.76%	03/29/2033	15,807	15,244,066	0.1
HSBC Holdings PLC	5.55%	03/04/2030	12,570	12,939,632	0.1
HSBC Holdings PLC(d)	6.38%	03/30/2025	4,594	4,594,000	0.0
HSBC Holdings PLC	6.55%	06/20/2034	26,895	28,798,845	0.2
HSBC Holdings PLC, Series E(d)	4.75%	07/04/2029	EUR 9,250	9,813,161	0.1
ING Groep NV(d)	6.50%	04/16/2025	USD 13,851	13,818,946	0.1
Intesa Sanpaolo SpA	4.20%	06/01/2032	700	614,788	0.0
Intesa Sanpaolo SpA	5.71%	01/15/2026	11,463	11,500,288	0.1
Intesa Sanpaolo SpA	6.63%	06/20/2033	16,743	18,018,356	0.1
Intesa Sanpaolo SpA	7.20%	11/28/2033	13,934	15,646,818	0.1
Intesa Sanpaolo SpA	8.25%	11/21/2033	2,500	2,861,547	0.0
Intesa Sanpaolo SpA, Series E.	8.51%	09/20/2032	GBP 582	847,322	0.0
JPMorgan Chase & Co.	2.96%	01/25/2033	USD 5,274	4,667,390	0.0
Lloyds Banking Group PLC(d)	7.50%	09/27/2025	2,104	2,117,946	0.0
Morgan Stanley	5.42%	07/21/2034	4,475	4,596,996	0.0
NatWest Group PLC	3.03%	11/28/2035	2,116	1,864,540	0.0
NatWest Group PLC(d)	5.13%	05/12/2027	GBP 23,619	29,390,343	0.2
NatWest Group PLC	6.48%	06/01/2034	USD 3,423	3,579,973	0.0
NatWest Group PLC(d)	8.13%	11/10/2033	3,837	4,051,114	0.0
Nordea Bank Abp(d)	3.75%	03/01/2029	33,653	29,055,829	0.2
Regions Bank/Birmingham AL	6.45%	06/26/2037	28,048	29,812,756	0.2
Santander Holdings USA, Inc.	6.17%	01/09/2030	6,045	6,261,783	0.0
Santander Holdings USA, Inc.	6.57%	06/12/2029	2,459	2,573,130	0.0
Skandinaviska Enskilda Banken AB(d)	6.88%	06/30/2027	600	606,196	0.0
Societe Generale SA	5.52%	01/19/2028	53,898	54,291,341	0.3
Societe Generale SA	7.37%	01/10/2053	914	956,236	0.0
Standard Chartered PLC(b) (d)	7.03%	01/30/2027	16,000	15,182,047	0.1
Svenska Handelsbanken AB(d)	4.75%	03/01/2031	17,600	15,740,356	0.1
Swedbank AB(d)	4.00%	03/17/2029	5,000	4,301,012	0.0
Swedbank AB(d)	7.63%	03/17/2028	20,600	21,018,545	0.1
Synchrony Financial	5.94%	08/02/2030	14,409	14,670,601	0.1
UBS Group AG	5.62%	09/13/2030	13,348	13,838,720	0.1
UBS Group AG(d)	7.00%	02/19/2025	32,133	32,171,798	0.2
UBS Group AG	9.02%	11/15/2033	2,500	3,113,393	0.0
UBS Group AG(d)	9.25%	11/13/2028	3,797	4,186,984	0.0
UBS Group AG(d)	9.25%	11/13/2033	3,616	4,171,991	0.0
UniCredit SpA	1.80%	01/20/2030	EUR 970	978,693	0.0
UniCredit SpA, Series E	2.20%	07/22/2027	511	553,937	0.0
UniCredit SpA, Series E	4.30%	01/23/2031	784	889,716	0.0
Western Alliance Bancorp	3.00%	06/15/2031	USD 1,206	1,095,487	0.0
				<u>1,087,847,526</u>	<u>6.7</u>
FINANZEN					
Aircastle Ltd.	2.85%	01/26/2028	19,115	17,687,417	0.1
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	30,442	30,356,858	0.2
Aircastle Ltd.(d)	5.25%	06/15/2026	22,917	22,489,739	0.1
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	1,558	1,490,824	0.0
Aviation Capital Group LLC	1.95%	09/20/2026	9,554	8,982,645	0.1
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	3,945	3,781,447	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	7,715	7,626,310	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	USD 5,387	\$ 5,353,763	0.0%
ILFC E-Capital Trust I(e)	7.16%	12/21/2065	9,500	7,523,480	0.1
				<u>105,292,483</u>	<u>0.7</u>
VERSICHERUNGEN					
Allstate Corp. (The)	6.50%	05/15/2057	38,218	39,628,283	0.2
Aon Corp.	8.21%	01/01/2027	13,915	14,936,147	0.1
Athene Global Funding	1.99%	08/19/2028	11,407	10,245,557	0.1
Athene Global Funding	2.55%	11/19/2030	2,225	1,939,133	0.0
Athene Global Funding	2.72%	01/07/2029	4,236	3,873,092	0.0
Athene Global Funding	5.53%	07/11/2031	32,429	33,181,459	0.2
Athene Global Funding	5.58%	01/09/2029	2,016	2,072,987	0.0
BNP Paribas Cardif SA(d)	4.03%	11/25/2025	EUR 800	878,879	0.0
Hartford Financial Services Group, Inc. (The), Series ICON(b)	7.50%	02/12/2047	USD 10,000	9,025,219	0.1
Hill City Funding Trust	4.05%	08/15/2041	978	781,093	0.0
Liberty Mutual Group, Inc.	4.13%	12/15/2051	228	213,945	0.0
Liberty Mutual Group, Inc.	4.30%	02/01/2061	177	116,271	0.0
Liberty Mutual Group, Inc.	4.63%	12/02/2030	EUR 1,017	1,171,223	0.0
Liberty Mutual Group, Inc.	7.80%	03/15/2037	USD 33,248	36,010,098	0.2
MetLife Capital Trust IV	7.88%	12/15/2037	7,000	7,687,448	0.1
MetLife, Inc.	10.75%	08/01/2039	16,185	22,061,841	0.1
Nationwide Financial Services, Inc.	6.75%	05/15/2037	3,000	3,056,154	0.0
Nationwide Mutual Insurance Co.(b)	7.89%	12/15/2024	5,000	5,019,280	0.0
Swiss RE Subordinated Finance PLC	5.70%	04/05/2035	21,400	22,000,905	0.1
Transatlantic Holdings, Inc.	8.00%	11/30/2039	7,430	9,599,608	0.1
Unum Group	4.13%	06/15/2051	574	438,993	0.0
Unum Group	4.50%	12/15/2049	11	9,064	0.0
				<u>223,946,679</u>	<u>1.3</u>
REITs					
American Tower Corp.	1.00%	01/15/2032	EUR 818	748,323	0.0
Digital Intrepid Holding BV	0.63%	07/15/2031	251	223,682	0.0
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	4.00%	01/15/2031	USD 33	30,594	0.0
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	6.75%	12/01/2033	630	685,768	0.0
Kilroy Realty LP	3.05%	02/15/2030	879	768,734	0.0
Newmark Group, Inc.	7.50%	01/12/2029	11,930	12,689,242	0.1
Prologis International Funding II SA, Series E	0.75%	03/23/2033	EUR 788	684,046	0.0
VICI Properties LP	6.13%	04/01/2054	USD 655	665,657	0.0
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	4.13%	08/15/2030	73	68,700	0.0
Welltower OP LLC	4.50%	12/01/2034	GBP 608	738,265	0.0
				<u>17,303,011</u>	<u>0.1</u>
				<u>1,434,389,699</u>	<u>8.8</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Alexander Funding Trust II	7.47%	07/31/2028	USD 9,775	10,513,806	0.1
American Electric Power Co., Inc.	6.95%	12/15/2054	9,334	9,717,641	0.1
Berkshire Hathaway Energy Co.	4.60%	05/01/2053	172	150,281	0.0
Berkshire Hathaway Energy Co.	5.95%	05/15/2037	381	411,849	0.0
Electricite de France SA(d)	9.13%	03/15/2033	5,683	6,412,757	0.0
Israel Electric Corp., Ltd.	7.75%	12/15/2027	5,775	6,117,109	0.0
Israel Electric Corp., Ltd., Series G	4.25%	08/14/2028	22,778	21,596,505	0.1
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	6.70%	09/01/2054	6,969	7,109,726	0.0
Niagara Mohawk Power Corp.	5.29%	01/17/2034	12,075	12,162,006	0.1
NRG Energy, Inc.	4.45%	06/15/2029	4,307	4,179,449	0.0
NRG Energy, Inc.	7.00%	03/15/2033	10,460	11,479,024	0.1
Pacific Gas & Electric Co.	5.55%	05/15/2029	8,245	8,486,087	0.1
Palomino Funding Trust I	7.23%	05/17/2028	16,763	17,907,334	0.1
				<u>116,243,574</u>	<u>0.7</u>
ERDGAS					
National Grid North America, Inc., Series E	1.05%	01/20/2031	EUR 777	735,451	0.0
National Grid North America, Inc., Series E	4.67%	09/12/2033	944	1,102,621	0.0
				<u>1,838,072</u>	<u>0.0</u>
				<u>118,081,646</u>	<u>0.7</u>
				<u>3,088,009,306</u>	<u>19.2</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Aris Mining Corp.	6.88%	08/09/2026	USD 6,021	5,847,858	0.0
Braskem Idesa SAPI	6.99%	02/20/2032	8,617	6,718,589	0.0
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029	30,726	25,790,790	0.2
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/10/2028	32,560	30,354,060	0.2
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030	6,569	5,754,116	0.0
Cia de Minas Buenaventura SAA	5.50%	07/23/2026	14,043	13,727,032	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
CSN Inova Ventures	6.75%	01/28/2028	USD 21,886	\$ 20,942,166	0.1%
CSN Resources SA	4.63%	06/10/2031	9,013	7,094,943	0.0
CSN Resources SA	7.63%	04/17/2026	12,983	12,964,434	0.1
Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	8.38%	07/23/2029	8,575	8,731,322	0.1
First Quantum Minerals Ltd.	6.88%	10/15/2027	38,055	37,638,678	0.2
First Quantum Minerals Ltd.	9.38%	03/01/2029	5,550	5,913,636	0.0
Indika Energy Tbk PT	8.75%	05/07/2029	15,865	16,177,342	0.1
Inversiones CMPC SA	6.13%	02/26/2034	2,845	2,986,924	0.0
JSW Steel Ltd.	3.95%	04/05/2027	12,435	11,844,337	0.1
JSW Steel Ltd.	5.05%	04/05/2032	5,695	5,212,705	0.0
Nexa Resources SA	6.50%	01/18/2028	9,423	9,690,967	0.1
Nexa Resources SA	6.75%	04/09/2034	13,495	14,150,826	0.1
OCP SA	3.75%	06/23/2031	5,000	4,478,125	0.0
OCP SA	6.75%	05/02/2034	8,010	8,540,662	0.1
Periama Holdings LLC/DE	5.95%	04/19/2026	6,551	6,526,761	0.0
Sasol Financing USA LLC	8.75%	05/03/2029	36,019	37,567,759	0.2
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	6.50%	11/07/2033	5,957	6,398,175	0.0
Stillwater Mining Co.	4.00%	11/16/2026	10,431	9,752,985	0.1
Stillwater Mining Co.	4.00%	11/16/2026	12,338	11,536,030	0.1
Stillwater Mining Co.	4.50%	11/16/2029	4,575	3,820,125	0.0
Suzano Austria GmbH	3.75%	01/15/2031	4,365	3,970,840	0.0
Suzano Austria GmbH	5.00%	01/15/2030	7,580	7,458,720	0.1
Suzano Austria GmbH	6.00%	01/15/2029	18,123	18,517,175	0.1
Suzano Austria GmbH, Series DM3N	3.13%	01/15/2032	5,618	4,783,727	0.0
UPL Corp., Ltd.	4.50%	03/08/2028	6,682	6,011,712	0.0
UPL Corp., Ltd.	4.63%	06/16/2030	10,296	8,767,662	0.1
Volcan Cia Minera SAA	4.38%	02/11/2026	11,588	9,918,633	0.1
				<u>389,589,816</u>	<u>2.3</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Cemex SAB de CV(d)	5.13%	06/08/2026	22,711	22,239,747	0.1
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	26,390	26,571,563	0.2
IHS Holding Ltd.	6.25%	11/29/2028	3,321	3,053,478	0.0
IRB Infrastructure Developers Ltd.	7.11%	03/11/2032	5,805	5,971,894	0.0
St. Marys Cement, Inc. Canada	5.75%	04/02/2034	3,498	3,531,359	0.0
				<u>61,368,041</u>	<u>0.3</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030	26,197	24,191,292	0.2
Prosus NV	3.06%	07/13/2031	31,537	27,052,833	0.2
Telecomunicaciones Digitales SA	4.50%	01/30/2030	463	421,043	0.0
Weibo Corp.	3.38%	07/08/2030	8,596	7,708,033	0.1
				<u>59,373,201</u>	<u>0.5</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
C&W Senior Finance Ltd.	6.88%	09/15/2027	23,371	23,000,489	0.1
CT Trust	5.13%	02/03/2032	7,402	6,634,042	0.0
HTA Group Ltd./Mauritius	7.50%	06/04/2029	6,900	6,944,505	0.0
Millicom International Cellular SA	7.38%	04/02/2032	4,980	5,031,188	0.0
Sable International Finance Ltd.	5.75%	09/07/2027	11,425	11,257,167	0.1
Turk Telekomunikasyon AS	7.38%	05/20/2029	7,628	7,757,523	0.1
Xiaomi Best Time International Ltd.	3.38%	04/29/2030	3,817	3,506,869	0.0
				<u>64,131,783</u>	<u>0.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Ford Otomotiv Sanayi AS	7.13%	04/25/2029	8,387	8,617,055	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
GENM Capital Labuan Ltd.	3.88%	04/19/2031	7,787	6,962,065	0.0
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Falabella SA	3.38%	01/15/2032	8,614	7,356,894	0.1
Falabella SA	3.38%	01/15/2032	6,830	5,833,247	0.0
Falabella SA	3.75%	10/30/2027	8,688	8,243,609	0.1
				<u>21,433,750</u>	<u>0.2</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Arcelik AS	8.50%	09/25/2028	4,150	4,380,844	0.0
BRF GmbH	4.35%	09/29/2026	7,508	7,301,755	0.0
Cencosud SA	5.95%	05/28/2031	8,365	8,619,296	0.1
Central American Bottling Corp./CBC Bottling Holdeco SL/ Beliv Holdco SL	5.25%	04/27/2029	6,201	5,978,152	0.0
MARB BondCo PLC	3.95%	01/29/2031	26,463	22,387,698	0.1
Natura &Co Luxembourg Holdings SARL	4.13%	05/03/2028	2,192	1,991,556	0.0
Natura &Co Luxembourg Holdings SARL	6.00%	04/19/2029	9,791	9,304,289	0.1
Rede D'or Finance SARL	4.50%	01/22/2030	5,751	5,391,562	0.0
Rede D'or Finance SARL	4.95%	01/17/2028	4,716	4,633,470	0.0
				<u>69,988,622</u>	<u>0.3</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ENERGIE					
Acu Petroleo Luxembourg SARL	7.50%	01/13/2032	USD 8,598	\$ 8,503,584	0.1%
Azure Power Solar Energy Pvt. Ltd.	5.65%	12/24/2024	7,466	7,441,064	0.1
Canacol Energy Ltd.	5.75%	11/24/2028	7,840	4,517,800	0.0
Canacol Energy Ltd.	5.75%	11/24/2028	3,346	1,928,132	0.0
Cosan Luxembourg SA	5.50%	09/20/2029	16,818	16,321,869	0.1
Ecopetrol SA	4.63%	11/02/2031	14,134	11,953,124	0.1
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	17,871	17,808,451	0.1
Ecopetrol SA	8.63%	01/19/2029	20,972	22,446,541	0.1
Geopark Ltd.	5.50%	01/17/2027	5,066	4,777,897	0.0
Gran Tierra Energy, Inc.	9.50%	10/15/2029	12,259	11,914,216	0.1
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.	5.50%	04/06/2025	22,327	22,194,433	0.1
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.	5.50%	04/06/2025	3,500	3,479,219	0.0
HPCL-Mittal Energy Ltd.	5.45%	10/22/2026	3,062	3,017,509	0.0
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	8.55%	09/18/2033	13,741	15,372,744	0.1
KazMunayGas National Co. JSC.	4.75%	04/19/2027	5,129	5,068,683	0.0
KazMunayGas National Co. JSC.	5.38%	04/24/2030	22,742	22,486,152	0.1
Medco Bell Pte Ltd.	6.38%	01/30/2027	18,828	18,686,790	0.1
Medco Maple Tree Pte Ltd.	8.96%	04/27/2029	4,092	4,329,847	0.0
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034	9,606	9,327,643	0.1
Oleoducto Central SA	4.00%	07/14/2027	8,463	8,079,520	0.1
Raizen Fuels Finance SA	6.45%	03/05/2034	14,220	14,981,394	0.1
SierraCol Energy Andina LLC	6.00%	06/15/2028	6,576	5,971,863	0.0
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	3.25%	08/15/2030	27,776	23,731,259	0.2
				<u>264,339,734</u>	<u>1.6</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Bidvest Group UK PLC (The)	3.63%	09/23/2026	7,895	7,523,935	0.1
TECHNOLOGIE					
Baidu, Inc.	3.43%	04/07/2030	304	286,383	0.0
Lenovo Group Ltd.	3.42%	11/02/2030	2,752	2,513,780	0.0
Lenovo Group Ltd.	5.83%	01/27/2028	11,621	11,922,420	0.1
Lenovo Group Ltd.	6.54%	07/27/2032	6,850	7,401,425	0.1
Xiaomi Best Time International Ltd.	2.88%	07/14/2031	13,574	11,758,477	0.1
				<u>33,882,485</u>	<u>0.3</u>
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN					
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	6,731	6,267,792	0.0
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	4.38%	07/03/2029	27,190	25,422,650	0.2
TAV Havalimanlari Holding AS	8.50%	12/07/2028	3,218	3,352,754	0.0
				<u>28,775,404</u>	<u>0.2</u>
				<u>1,022,253,683</u>	<u>6.2</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Absa Group Ltd.(d)	6.38%	05/27/2026	6,561	6,427,746	0.0
Akbank TAS.	7.50%	01/20/2030	5,315	5,409,660	0.0
Banco de Credito del Peru SA	5.85%	01/11/2029	9,240	9,549,751	0.1
BBVA Bancomer SA/Texas	5.88%	09/13/2034	3,720	3,591,920	0.0
Türkiye Vakıflar Bankası TAO.	9.00%	10/12/2028	7,011	7,512,725	0.1
Yapı ve Kredi Bankası AS	9.25%	10/16/2028	5,800	6,294,798	0.0
				<u>38,786,600</u>	<u>0.2</u>
MAKLER					
China Great Wall International Holdings VI Ltd.	6.38%	01/02/2028	3,114	3,184,376	0.0
FINANZEN					
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	4.75%	04/27/2027	6,249	6,049,032	0.0
Huarong Finance 2017 Co., Ltd., Series E	4.25%	11/07/2027	854	810,531	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd., Series E	3.25%	11/13/2024	2,492	2,475,503	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd., Series E	4.63%	06/03/2026	8,049	7,888,020	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd., Series E	4.88%	11/22/2026	5,537	5,434,912	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd., Series E	5.50%	01/16/2025	13,140	13,109,778	0.1
				<u>35,767,776</u>	<u>0.2</u>
REITs					
Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030	25,005	23,035,856	0.1
Trust Fibra Uno	5.25%	01/30/2026	1,604	1,593,205	0.0
Trust Fibra Uno	6.95%	01/30/2044	3,173	2,906,270	0.0
				<u>27,535,331</u>	<u>0.1</u>
				<u>105,274,083</u>	<u>0.5</u>
STAATSANLEIHEN					
ANGOLA					
Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029	32,819	30,131,944	0.2
Angolan Government International Bond	9.13%	11/26/2049	20,250	17,041,641	0.1
				<u>47,173,585</u>	<u>0.3</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
ARGENTINIEN					
Argentine Republic Government International Bond	1.00%	07/09/2029	USD 17,568	\$ 10,566,863	0.1%
Argentine Republic Government International Bond	5.00%	01/09/2038	8,711	4,238,030	0.0
				<u>14,804,893</u>	<u>0.1</u>
KOLUMBIEN					
Colombia Government International Bond	4.13%	05/15/2051	12,840	8,037,198	0.1
Colombia Government International Bond	5.63%	02/26/2044	11,709	9,325,633	0.1
Colombia Government International Bond	8.00%	11/14/2035	3,980	4,222,780	0.0
				<u>21,585,611</u>	<u>0.2</u>
ELFENBEINKÜSTE					
Ivory Coast Government International Bond	4.88%	01/30/2032	EUR 35,687	34,152,461	0.2
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	USD 8,905	8,842,843	0.1
Ivory Coast Government International Bond	6.88%	10/17/2040	EUR 32,060	30,455,497	0.2
				<u>73,450,801</u>	<u>0.5</u>
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					
Dominican Republic International Bond	6.00%	07/19/2028	USD 25,254	25,743,423	0.2
Dominican Republic International Bond	8.63%	04/20/2027	22,564	23,537,185	0.2
				<u>49,280,608</u>	<u>0.4</u>
ECUADOR					
Ecuador Government International Bond	5.50%	07/31/2035	46,403	25,637,470	0.2
Ecuador Government International Bond	5.50%	07/31/2035	10,680	5,900,914	0.0
ÄGYPTEN					
Egypt Government International Bond	5.88%	02/16/2031	24,654	19,938,922	0.1
Egypt Government International Bond	7.30%	09/30/2033	3,437	2,818,340	0.0
Egypt Government International Bond	7.63%	05/29/2032	2,283	1,954,819	0.0
Egypt Government International Bond	8.50%	01/31/2047	7,580	5,862,656	0.0
Egypt Government International Bond	8.70%	03/01/2049	10,320	8,068,898	0.1
Egypt Government International Bond	8.88%	05/29/2050	22,855	18,162,583	0.1
				<u>56,806,218</u>	<u>0.3</u>
EL SALVADOR					
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	9,665	9,054,897	0.1
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	3,397	2,353,476	0.0
El Salvador Government International Bond	7.63%	02/01/2041	7,141	5,266,488	0.0
El Salvador Government International Bond	8.63%	02/28/2029	6,788	6,356,962	0.0
				<u>23,031,823</u>	<u>0.1</u>
GUATEMALA					
Guatemala Government Bond	6.05%	08/06/2031	7,885	8,039,073	0.1
KENIA					
Republic of Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027	16,016	15,345,330	0.1
LIBANON					
Lebanon Government International Bond, Series 10Y(f)	6.85%	03/23/2027	5,606	350,375	0.0
Lebanon Government International Bond, Series G(f)	1.00%	11/27/2026	10,759	672,438	0.0
				<u>1,022,813</u>	<u>0.0</u>
NIGERIA					
Nigeria Government International Bond	6.13%	09/28/2028	24,687	22,218,300	0.1
Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027	9,479	8,827,319	0.1
Nigeria Government International Bond	7.14%	02/23/2030	10,008	9,054,113	0.1
Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	14,105	11,301,631	0.1
Nigeria Government International Bond	7.88%	02/16/2032	17,700	15,753,000	0.1
Nigeria Government International Bond	8.25%	09/28/2051	12,213	9,633,004	0.1
				<u>76,787,367</u>	<u>0.6</u>
PANAMA					
Panama Government International Bond	7.50%	03/01/2031	5,415	5,794,050	0.0
SENEGAL					
Senegal Government International Bond	4.75%	03/13/2028	EUR 7,541	7,848,697	0.1
Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	USD 50,039	43,424,470	0.3
				<u>51,273,167</u>	<u>0.4</u>
SÜDAFRIKA					
Republic of South Africa Government International Bond	5.65%	09/27/2047	8,663	6,989,135	0.0
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	37,394	30,102,170	0.2
Republic of South Africa Government International Bond	6.30%	06/22/2048	1,684	1,458,765	0.0
				<u>38,550,070</u>	<u>0.2</u>
UKRAINE					
Ukraine Government International Bond	7.25%	03/15/2035	8,600	2,605,800	0.0
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2025	18,463	6,665,143	0.0
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2027	10,000	3,220,000	0.0
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2029	13,037	4,041,470	0.0
				<u>16,532,413</u>	<u>0.0</u>
				<u>531,016,206</u>	<u>3.5</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Adani Electricity Mumbai Ltd.	3.87%	07/22/2031	USD 8,467	\$ 7,302,788	0.0%
Adani Electricity Mumbai Ltd.	3.95%	02/12/2030	14,805	13,287,488	0.1
Adani Green Energy Ltd.	4.38%	09/08/2024	8,794	8,790,482	0.1
AES Andes SA.	6.30%	03/15/2029	6,209	6,397,319	0.0
AES Panama Generation Holdings SRL	4.38%	05/31/2030	1,795	1,605,541	0.0
AES Panama Generation Holdings SRL	4.38%	05/31/2030	3,571	3,193,817	0.0
Buffalo Energy Mexico Holdings/Buffalo Energy Infrastructure/ Buffalo Energy	7.88%	02/15/2039	13,290	14,249,804	0.1
Cometa Energia SA de CV.	6.38%	04/24/2035	6,906	6,975,447	0.0
Continuum Energy Aura Pte Ltd.	9.50%	02/24/2027	6,407	6,651,299	0.0
Continuum Green Energy India Pvt./Co-Issuers	7.50%	06/26/2033	7,650	7,862,747	0.1
Diamond II Ltd.	7.95%	07/28/2026	11,942	12,087,669	0.1
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027	1,661	1,602,074	0.0
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.25%	07/18/2029	8,485	7,651,943	0.1
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.38%	02/15/2031	18,852	16,429,707	0.1
Engie Energia Chile SA.	6.38%	04/17/2034	13,000	13,690,495	0.1
India Clean Energy Holdings.	4.50%	04/18/2027	11,748	10,988,051	0.1
Investment Energy Resources Ltd.	6.25%	04/26/2029	8,915	8,806,326	0.1
JSW Hydro Energy Ltd.	4.13%	05/18/2031	4,527	4,099,366	0.0
Kallpa Generacion SA.	4.13%	08/16/2027	3,002	2,907,797	0.0
Minejesa Capital BV	4.63%	08/10/2030	35,509	34,656,995	0.2
Sorik Marapi Geothermal Power PT	7.75%	08/05/2031	7,890	7,845,658	0.1
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	6.75%	04/24/2033	11,354	11,534,446	0.1
Terraform Global Operating LP.	6.13%	03/01/2026	2,777	2,777,467	0.0
				<u>211,394,726</u>	<u>1.4</u>
SONSTIGE VERSORUNGSBETRIEBE					
Aegea Finance SARL.	6.75%	05/20/2029	2,300	2,308,855	0.0
Aegea Finance SARL.	9.00%	01/20/2031	7,433	7,969,856	0.1
				<u>10,278,711</u>	<u>0.1</u>
				<u>221,673,437</u>	<u>1.5</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
Senegal Government International Bond, Series 7Y.	7.75%	06/10/2031	7,955	7,681,547	0.1
				<u>1,887,898,956</u>	<u>11.8</u>
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Bonds	4.00%	11/15/2052	101,000	97,180,938	0.6
U.S. Treasury Bonds	4.13%	08/15/2044	11,000	10,759,375	0.1
U.S. Treasury Bonds	4.25%	08/15/2054	9,000	9,081,563	0.1
U.S. Treasury Bonds	4.50%	02/15/2044	125,382	128,770,815	0.8
U.S. Treasury Bonds	4.63%	05/15/2044	68,160	71,120,700	0.4
U.S. Treasury Bonds	4.75%	11/15/2053	14,295	15,612,711	0.1
U.S. Treasury Bonds(g)	6.75%	08/15/2026	212,755	223,891,405	1.4
U.S. Treasury Notes(g)	4.00%	06/30/2028	24,933	25,143,271	0.1
U.S. Treasury Notes	4.25%	06/30/2029	18,000	18,402,188	0.1
U.S. Treasury Notes	4.38%	10/31/2024	20,684	20,655,314	0.1
U.S. Treasury Notes	4.63%	09/30/2028	150,000	154,875,000	1.0
				<u>775,493,280</u>	<u>4.8</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB SICAV I - Asia Income Opportunities Portfolio - Class ZT ...			2,186,465	182,591,722	1.1
AB SICAV I - Emerging Market Corporate Debt Portfolio - Class S.			4,017,647	115,386,820	0.7
AB SICAV I - Emerging Market Local Currency Debt Portfolio - Class ZT.			5,215,178	44,798,383	0.3
AB SICAV I - Sustainable Euro High Yield Portfolio - Class S ...			5,216,996	194,631,776	1.2
AB SICAV I - US High Yield Portfolio - Class ZT.			4,895,445	66,724,919	0.4
				<u>604,133,620</u>	<u>3.7</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABLEN VERZINSLICH					
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-DNA1, Series 2015-DNA1, Class B(b)	14.66%	10/25/2027	USD 31,959	33,263,791	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-DNA2, Series 2015-DNA2, Class B(b)	13.01%	12/25/2027	38,650	40,085,925	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-DNA3, Series 2015-DNA3, Class B(b)	14.81%	04/25/2028	15,180	16,253,033	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-HQ2, Series 2015-HQ2, Class B(b)	13.41%	05/25/2025	USD 1,411	\$ 1,472,950	0.0%
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-HQA1, Series 2015-HQA1, Class B(b)	14.26%	03/25/2028	19,229	20,012,965	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-HQA2, Series 2015-HQA2, Class B(b)	15.96%	05/25/2028	10,399	10,865,408	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-DNA3, Series 2016-DNA3, Class B(b)	16.71%	12/25/2028	7,167	8,114,865	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-DNA4, Series 2016-DNA4, Class B(b)	14.06%	03/25/2029	8,611	9,577,177	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-HQA1, Series 2016-HQA1, Class B(b)	18.21%	09/25/2028	16,355	18,662,621	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-HQA2, Series 2016-HQA2, Class B(b)	16.96%	11/25/2028	13,593	15,324,761	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-HQA4, Series 2016-HQA4, Class B(b)	14.21%	04/25/2029	2,282	2,523,817	0.0
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
Series 2016-C01, Class 1B(b)	17.21%	08/25/2028	39,007	43,861,720	0.3
Series 2016-C02, Class 1B(b)	17.71%	09/25/2028	21,376	24,566,603	0.2
Series 2016-C03, Class 1B(b)	17.21%	10/25/2028	7,756	8,916,234	0.1
Series 2016-C03, Class 2B(b)	18.21%	10/25/2028	18,449	21,189,896	0.2
Series 2016-C04, Class 1B(b)	15.71%	01/25/2029	45,964	52,382,604	0.3
Series 2016-C05, Class 2B(b)	16.21%	01/25/2029	35,932	40,857,783	0.3
Series 2016-C06, Class 1B(b)	14.71%	04/25/2029	21,119	23,910,881	0.2
Series 2016-C07, Class 2B(b)	14.96%	05/25/2029	27,635	31,331,811	0.2
				<u>423,174,845</u>	<u>3.0</u>
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICS					
Series 4398, Class IO(h)	6.00%	10/15/2037	15,530	2,565,780	0.0
Series 4976, Class MI(h)	4.50%	05/25/2050	18,426	4,235,067	0.0
Series 4981, Class MI(h)	5.00%	06/25/2050	27,344	5,835,188	0.1
Series 4987, Class IC(h)	4.50%	06/25/2050	62,693	13,969,008	0.1
Series 4993, Class LI(h)	5.00%	07/25/2050	7,369	1,443,404	0.0
Series 5008, Class AI(h)	3.50%	09/25/2050	8,846	1,667,428	0.0
Series 5011, Class MI(h)	3.00%	09/25/2050	8,466	1,399,728	0.0
Series 5013, Class JI(h)	4.00%	09/25/2050	14,453	3,008,242	0.0
Series 5015, Class BI(h)	4.00%	09/25/2050	14,268	2,852,779	0.0
Series 5018, Class AI(h)	4.00%	10/25/2050	7,756	1,553,196	0.0
Series 5018, Class GI(h)	4.50%	10/25/2050	9,979	2,229,570	0.0
Series 5024, Class DI(h)	4.00%	10/25/2050	3,497	726,880	0.0
Series 5030, Class EI(h)	3.50%	10/25/2050	3,212	559,743	0.0
Series 5036, Class IT(h)	4.00%	03/25/2050	4,394	899,963	0.0
Series 5040, Class AI(h)	3.50%	11/25/2050	1,252	215,009	0.0
Series 5043, Class IO(h)	5.00%	11/25/2050	8,616	1,932,576	0.0
Series 5049, Class CI(h)	3.50%	12/25/2050	14,962	2,700,051	0.0
Series 5052, Class IK(h)	4.00%	12/25/2050	13,198	2,699,239	0.0
Federal National Mortgage Association REMICS					
Series 2010-109, Class IQ(h)	5.50%	08/25/2040	2,072	121,724	0.0
Series 2013-66, Class LI(h)	7.00%	07/25/2043	7,125	955,192	0.0
Series 2015-49, Class LI(h)	5.00%	07/25/2045	7,804	1,218,410	0.0
Series 2016-26, Class IO(h)	5.00%	05/25/2046	7,938	1,096,387	0.0
Series 2019-4, Class AI(h)	6.00%	08/25/2038	13,437	2,233,775	0.0
Series 2020-76, Class GI(h)	4.00%	11/25/2050	9,182	1,925,173	0.0
Series 2020-89, Class KI(h)	4.00%	12/25/2050	43,458	8,369,595	0.1
Series 2020-96, Class KI(h)	2.50%	01/25/2051	5,001	780,632	0.0
Series 2021-18, Class IT(h)	3.00%	04/25/2051	9,220	1,493,662	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2021-41, Class UI(h)	3.50%	03/20/2051	18,478	3,353,494	0.0
				<u>72,040,895</u>	<u>0.3</u>
VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICS					
Series 4125, Class SA(b) (i)	0.68%	11/15/2042	4,081	534,364	0.0
Series 4248, Class SL(b) (i)	0.58%	05/15/2041	11,167	1,021,706	0.0
Series 4701, Class NS(b) (i)	0.68%	08/15/2039	4,306	467,806	0.0
Series 4736, Class LS(b) (i)	0.73%	12/15/2047	17,369	2,447,404	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 4736, Class SM(b) (i)	0.73%	12/15/2047	USD 34,749	\$ 4,634,328	0.1%
Series 4774, Class BS(b) (i)	0.73%	02/15/2048	16,290	2,253,741	0.0
Series 4954, Class SL(b) (i)	0.59%	02/25/2050	12,736	1,500,250	0.0
Series 4981, Class HS(b) (i)	0.64%	06/25/2050	40,264	4,444,063	0.0
Series 4981, Class JS(b) (i)	0.64%	06/25/2050	61,191	9,202,668	0.1
Federal National Mortgage Association REMICS					
Series 2005-91, Class SD(b) (i)	1.24%	10/25/2035	3,043	312,065	0.0
Series 2012-70, Class HS(b) (i)	0.54%	07/25/2042	2,395	360,101	0.0
Series 2013-15, Class SA(b) (i)	0.69%	03/25/2043	10,426	1,448,438	0.0
Series 2015-26, Class SH(b) (i)	0.99%	05/25/2045	3,468	530,009	0.0
Series 2016-64, Class SP(b) (i)	0.54%	09/25/2046	11,874	1,496,522	0.0
Series 2016-89, Class SH(b) (i)	0.54%	12/25/2046	8,797	1,123,097	0.0
Series 2017-97, Class SW(b) (i)	0.74%	12/25/2047	19,687	2,886,705	0.0
Series 2018-36, Class SG(b) (i)	0.74%	06/25/2048	8,714	1,161,422	0.0
Series 2018-43, Class SB(b) (i)	0.74%	06/25/2048	4,794	529,298	0.0
Series 2019-38, Class SM(b) (i)	0.59%	07/25/2049	3,551	396,563	0.0
Series 2019-65, Class SY(b) (i)	0.59%	11/25/2049	7,357	872,019	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2009-76, Class SB(b) (i)	0.65%	09/16/2039	3,770	336,368	0.0
Series 2015-3, Class DS(b) (i)	0.15%	11/20/2041	6,474	190,440	0.0
Series 2017-134, Class MS(b) (i)	0.75%	09/20/2047	4,857	723,955	0.0
Series 2017-161, Class CS(b) (i)	0.80%	10/20/2047	9,895	1,032,637	0.0
Series 2020-47, Class SG(b) (i)	0.55%	02/20/2049	8,263	831,844	0.0
				40,737,813	0.2
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH					
Alternative Loan Trust					
Series 2006-42, Class 1A6	6.00%	01/25/2047	2,424	1,296,089	0.0
Series 2006-24CB, Class A16	5.75%	08/25/2036	1,260	678,398	0.0
Series 2006-26CB, Class A6	6.25%	09/25/2036	644	320,122	0.0
Series 2006-26CB, Class A8	6.25%	09/25/2036	2,435	1,211,263	0.0
Series 2006-J5, Class 1A1	6.50%	09/25/2036	1,556	850,611	0.0
Series 2007-15CB, Class A19	5.75%	07/25/2037	1,262	729,490	0.0
Series 2007-16CB, Class 1A7	6.00%	08/25/2037	2,548	1,930,393	0.0
Bear Stearns ARM Trust, Series 2007-4, Class 22A1	4.44%	06/25/2047	4,654	4,199,435	0.0
ChaseFlex Trust, Series 2007-1, Class 1A3	6.50%	02/25/2037	4,250	1,525,025	0.0
CHL Mortgage Pass-Through Trust					
Series 2006-13, Class 1A19	6.25%	09/25/2036	555	245,760	0.0
Series 2007-3, Class A30	5.75%	04/25/2037	1,086	506,706	0.0
Series 2007-HY4, Class 1A1	4.64%	09/25/2047	1,434	1,308,724	0.0
Citigroup Mortgage Loan Trust, Series 2007-AR4,					
Class 1A1A	4.71%	03/25/2037	849	707,885	0.0
CitiMortgage Alternative Loan Trust, Series 2007-A3,					
Class 1A4	5.75%	03/25/2037	384	346,555	0.0
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust,					
Series 2006-AA3, Class A1	5.65%	06/25/2036	998	778,101	0.0
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust,					
Series 2007-6XS, Class 2A5S(b)	6.50%	02/25/2047	3,454	1,188,335	0.0
Residential Accredit Loans, Inc. Trust					
Series 2005-QA10, Class A31	5.28%	09/25/2035	3,102	2,106,893	0.0
Series 2005-QS14, Class 3A1	6.00%	09/25/2035	669	560,620	0.0
Residential Asset Securitization Trust					
Series 2006-A8, Class 3A4	6.00%	08/25/2036	2,252	1,038,239	0.0
Series 2007-A1, Class A8	6.00%	03/25/2037	3,806	1,182,698	0.0
Series 2007-A5, Class 2A3	6.00%	05/25/2037	967	511,794	0.0
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates					
WMALT Trust, Series 2006-3, Class 3CB4	6.00%	04/25/2036	367	312,303	0.0
				23,535,439	0.0
NICHT STAATLICH VARIABEL VERZINSLICH					
Alternative Loan Trust, Series 2007-7T2, Class A3(b)	5.99%	04/25/2037	5,953	2,068,591	0.0
CHL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2007-13, Class A7(b)	5.99%	08/25/2037	2,043	788,171	0.0
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust,					
Series 2007-FA2, Class 1A6(b) (i)	0.16%	04/25/2037	1,529	146,695	0.0
Impac Secured Assets Corp., Series 2005-2, Class A2D(b)	6.25%	03/25/2036	889	718,475	0.0
Lehman XS Trust					
Series 2007-10H, Class 2AIO(b) (i)	1.54%	07/25/2037	2,004	204,332	0.0
Series 2007-16N, Class 2A2(b)	7.09%	09/25/2047	1,432	1,279,212	0.0
PHH Alternative Mortgage Trust, Series 2007-2, Class 1A3(b)	6.05%	05/25/2037	633	559,870	0.0
RBSGC Mortgage Loan Trust, Series 2007-B, Class 1A4(b)	5.84%	01/25/2037	768	377,121	0.0
Residential Accredit Loans, Inc. Trust,					
Series 2006-QS18, Class 2A2(b) (i)	1.16%	12/25/2036	4,896	616,903	0.0
				6,759,370	0.0
				566,248,362	3.5

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %	
QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE						
QUASI-STAAATSANLEIHEN						
ASERBAIDSCHAN						
	Southern Gas Corridor CJSC	6.88%	03/24/2026	USD 13,374	\$ 13,599,686	0.1%
CHILE						
	Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.00%	09/30/2029	11,565	10,498,852	0.1
	Corp. Nacional del Cobre de Chile	5.95%	01/08/2034	13,941	14,463,787	0.1
	Corp. Nacional del Cobre de Chile	6.44%	01/26/2036	7,699	8,254,772	0.1
	Empresa Nacional del Petroleo	5.95%	07/30/2034	6,821	7,076,788	0.0
					40,294,199	0.3
UNGARN						
	MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt	6.50%	06/29/2028	3,472	3,597,860	0.0
INDONESIEN						
	Indonesia Asahan Aluminium PT/ Mineral Industri Indonesia Persero PT	4.75%	05/15/2025	1,131	1,125,698	0.0
	Indonesia Asahan Aluminium PT/ Mineral Industri Indonesia Persero PT	5.45%	05/15/2030	1,209	1,220,256	0.0
					2,345,954	0.0
MEXIKO						
	Comision Federal de Electricidad	3.35%	02/09/2031	12,749	10,976,092	0.1
	Comision Federal de Electricidad	3.88%	07/26/2033	9,050	7,630,326	0.1
	Comision Federal de Electricidad	4.69%	05/15/2029	17,841	17,188,688	0.1
	Petroleos Mexicanos	6.38%	01/23/2045	10,474	7,047,038	0.0
	Petroleos Mexicanos	6.50%	01/23/2029	6,026	5,530,738	0.0
	Petroleos Mexicanos	6.70%	02/16/2032	30,309	26,020,277	0.2
	Petroleos Mexicanos	8.75%	06/02/2029	18,500	18,342,750	0.1
					92,735,909	0.6
PANAMA						
	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	4.00%	08/11/2041	2,153	1,729,462	0.0
	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	5.13%	08/11/2061	1,161	912,116	0.0
					2,641,578	0.0
SÜDAFRIKA						
	Transnet SOC Ltd.	8.25%	02/06/2028	28,535	29,346,535	0.2
TRINIDAD UND TOBAGO						
	Trinidad Generation UnLtd.	5.25%	11/04/2027	217	211,250	0.0
TÜRKEI						
	TC Ziraat Bankasi AS	8.00%	01/16/2029	7,367	7,615,636	0.1
	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS	9.00%	01/28/2027	2,672	2,825,640	0.0
					10,441,276	0.1
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						
	DP World Crescent Ltd., Series E	3.88%	07/18/2029	899	867,499	0.0
	DP World Ltd./United Arab Emirates	5.63%	09/25/2048	3,782	3,765,454	0.0
	DP World Salaam(d)	6.00%	10/01/2025	21,915	21,816,383	0.1
					26,449,336	0.1
					221,663,583	1.4
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
	Consolidated Energy Finance SA	5.00%	10/15/2028	EUR 6,188	5,690,738	0.0
	Consolidated Energy Finance SA	6.50%	05/15/2026	USD 1,041	1,024,552	0.0
					6,715,290	0.0
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE						
	Allwyn Entertainment Financing UK PLC	7.88%	04/30/2029	4,190	4,372,128	0.0
	Allwyn International AS	3.88%	02/15/2027	EUR 9,426	10,263,208	0.1
	Melco Resorts Finance Ltd.	5.38%	12/04/2029	USD 10,973	10,006,279	0.1
	Melco Resorts Finance Ltd.	5.63%	07/17/2027	10,154	9,779,571	0.1
	Melco Resorts Finance Ltd.	5.75%	07/21/2028	7,577	7,215,198	0.1
	Melco Resorts Finance Ltd.	7.63%	04/17/2032	6,465	6,472,807	0.1
	MGM China Holdings Ltd.	5.25%	06/18/2025	5,982	5,936,178	0.0
	MGM China Holdings Ltd.	5.88%	05/15/2026	6,242	6,214,691	0.0
	MGM China Holdings Ltd.	7.13%	06/26/2031	8,157	8,343,045	0.1
	Studio City Co., Ltd.	7.00%	02/15/2027	3,664	3,686,900	0.0
	Studio City Finance Ltd.	6.00%	07/15/2025	6,320	6,304,200	0.0
	Wynn Macau Ltd.	4.88%	10/01/2024	1,000	997,260	0.0
	Wynn Macau Ltd.	5.13%	12/15/2029	3,667	3,371,348	0.0
	Wynn Macau Ltd.	5.50%	01/15/2026	18,527	18,295,413	0.1
	Wynn Macau Ltd.	5.50%	10/01/2027	16,792	16,235,177	0.1
	Wynn Macau Ltd.	5.63%	08/26/2028	10,791	10,283,823	0.1
					127,777,226	0.9

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	4.75%	05/09/2027	USD 26,195	\$ 25,699,914	0.2%
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	5.13%	05/09/2029	20,440	20,248,477	0.1
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	6.75%	03/01/2028	4,961	5,145,053	0.0
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	7.88%	09/15/2029	5,217	5,747,948	0.0
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	8.13%	09/15/2031	5,539	6,335,560	0.0
				<u>63,176,952</u>	<u>0.3</u>
ENERGIE					
Leviathan Bond Ltd.	6.13%	06/30/2025	9,030	8,888,102	0.1
Leviathan Bond Ltd.	6.50%	06/30/2027	15,098	14,456,381	0.1
				<u>23,344,483</u>	<u>0.2</u>
				<u>221,013,951</u>	<u>1.4</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class E(b)	11.56%	04/15/2034	5,000	4,999,880	0.0
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class E(b)	11.92%	04/15/2034	4,063	4,066,896	0.0
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class E(b)	11.69%	07/20/2034	2,500	2,431,337	0.0
Apidos CLO XXXIII, Series 2015-23A, Class ER(b)	11.76%	04/15/2033	1,752	1,754,847	0.0
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class E(b)	11.29%	04/20/2034	3,000	2,995,095	0.0
Ballyrock CLO 17 Ltd., Series 2021-17A, Class D(b)	11.52%	10/20/2034	5,030	4,820,531	0.0
Clover CLO LLC, Series 2021-3A, Class E(b)	12.01%	01/25/2035	7,600	7,431,949	0.1
Dryden 57 CLO Ltd., Series 2018-57A, Class E(b)	10.58%	05/15/2031	6,004	5,474,105	0.0
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(b)	12.02%	04/15/2034	3,600	3,602,538	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 Ltd., Series 2018-29A, Class D(b)	8.64%	10/19/2031	3,000	3,004,467	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 Ltd., Series 2019-33A, Class ER(b)	11.80%	10/16/2033	8,200	8,199,139	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 Ltd., Series 2020-39A, Class ER(b)	12.48%	04/20/2038	2,250	2,264,850	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 Ltd., Series 2021-42A, Class E(b)	11.50%	07/16/2035	2,750	2,748,240	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 44 Ltd., Series 2021-44A, Class E(b)	11.55%	10/16/2034	750	750,041	0.0
OZLM XVIII Ltd., Series 2018-18A, Class E(b)	11.06%	04/15/2031	10,000	9,038,250	0.1
Peace Park CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(b)	11.54%	10/20/2034	3,700	3,704,155	0.0
PPM CLO 5 Ltd., Series 2021-5A, Class E(b)	12.04%	10/18/2034	2,050	1,953,648	0.0
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(b)	11.90%	07/20/2034	2,000	1,999,576	0.0
				<u>71,239,544</u>	<u>0.3</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E	4.80%	02/10/2036	11,700	9,003,680	0.1
CCUBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class XA(h)	1.16%	11/15/2050	4,343	103,254	0.0
CFCRE Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C8, Class XA(h)	1.64%	06/15/2050	7,422	220,582	0.0
Citigroup Commercial Mortgage Trust Series 2014-GC23, Class D	4.63%	07/10/2047	15,574	13,468,895	0.1
Series 2015-GC29, Class XA(h)	1.15%	04/10/2048	26,641	69,831	0.0
Series 2017-P8, Class XA(h)	1.01%	09/15/2050	44,819	887,404	0.0
Series 2018-C6, Class XA(h)	0.93%	11/10/2051	2,980	81,184	0.0
Commercial Mortgage Trust Series 2010-C1, Class F	4.00%	07/10/2046	3,049	2,652,468	0.0
Series 2012-CR3, Class F(b)	4.75%	10/15/2045	816	45,311	0.0
Series 2014-CR16, Class D	4.95%	04/10/2047	20,000	16,400,098	0.1
Series 2014-CR20, Class XA(h)	0.89%	11/10/2047	23,810	555	0.0
Series 2016-DC2, Class XA(h)	1.07%	02/10/2049	31,334	266,475	0.0
Series 2017-COR2, Class XA(h)	1.30%	09/10/2050	17,215	445,467	0.0
GS Mortgage Securities Trust Series 2011-GC5, Class D	5.30%	08/10/2044	2,801	1,446,749	0.0
Series 2017-GS7, Class XA(h)	1.22%	08/10/2050	54,696	1,300,247	0.0
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2013-C14, Class D	4.17%	08/15/2046	3,001	2,165,394	0.0
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust Series 2015-C22, Class XA(h)	1.11%	04/15/2048	59,469	83,250	0.0
Series 2016-C30, Class XA(h)	1.42%	09/15/2049	51,682	876,870	0.0
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2016-BNK2, Class XA(h)	1.08%	11/15/2049	71,230	1,078,005	0.0
UBS Commercial Mortgage Trust Series 2017-C2, Class XA(h)	1.21%	08/15/2050	2,320	56,031	0.0
Series 2018-C10, Class XA(h)	1.02%	05/15/2051	78,039	2,086,604	0.0
Series 2018-C14, Class XA(h)	1.04%	12/15/2051	38,642	1,147,161	0.0
Series 2018-C15, Class XA(h)	1.05%	12/15/2051	63,105	1,937,346	0.0
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust Series 2016-C33, Class XA(h)	1.72%	03/15/2059	52,447	876,530	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Series 2016-C35, Class XA(h)	2.03%	07/15/2048	USD 4,517	\$ 111,579	0.0%
Series 2016-LC24, Class XA(h)	1.75%	10/15/2049	75,578	1,882,484	0.0
Series 2017-C38, Class XA(h)	1.06%	07/15/2050	22,803	448,680	0.0
Series 2018-C48, Class XA(h)	1.10%	01/15/2052	27,405	898,132	0.0
WFRBS Commercial Mortgage Trust, Series 2014-C20, Class D	3.99%	05/15/2047	3,518	352,067	0.0
				<u>60,392,333</u>	<u>0.3</u>
SCHWELLENMÄRKTE – LOKALE WÄHRUNG					
STAATSANLEIHEN					
Colombian TES, Series B	7.25%	10/26/2050	COP 239,998,400	39,419,781	0.2
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN					
VEREINIGTE STAATEN					
State of California, Series 2010	7.60%	11/01/2040	5,645	7,073,557	0.0
State of Illinois, Series 2010	7.35%	07/01/2035	16,696	18,251,991	0.1
				<u>25,325,548</u>	<u>0.1</u>
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
RUMÄNIEN					
Romanian Government International Bond	5.88%	01/30/2029	USD 14,202	14,450,535	0.1
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE					
BAHRAIN					
Bahrain Government International Bond	5.45%	09/16/2032	2,327	2,209,923	0.0
Bahrain Government International Bond	6.75%	09/20/2029	6,000	6,210,000	0.1
				<u>8,419,923</u>	<u>0.1</u>
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE ABS – VARIABEL VERZINSLICH					
Pagaya AI Debt, Series 2024-S1, Class ABC(e)	7.20%	09/15/2031	8,151	8,150,737	0.0
BEZUGSRECHTE					
VERSORGUNG					
UNABHÄNGIGE STROM- UND ERNEUERBARE ELEKTRIZITÄTSPRODUZENTEN					
Vistra Energy Corp., expiring 12/31/2049			454,387	556,624	0.0
STAMMAKTIEN					
Battalion Oil Corp.			393	1,375	0.0
SandRidge Energy, Inc.			3,888	51,633	0.0
				<u>53,008</u>	<u>0.0</u>
				<u>15,178,961,161</u>	<u>93.7</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
ASP Unifrax Holdings, Inc.	7.50%	09/30/2029	USD 14,148	7,115,586	0.1
Magnetation LLC/Mag Finance Corp.(j) (k)	11.00%	05/15/2018	40,106	0	0.0
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	4.38%	11/01/2026	EUR 5,856	6,438,542	0.0
WR Grace Holdings LLC	4.88%	06/15/2027	USD 21,166	20,728,504	0.1
				<u>34,282,632</u>	<u>0.2</u>
INVESTITIONSGÜTER					
TK Elevator US Newco, Inc.	5.25%	07/15/2027	16,052	15,790,102	0.1
WESCO Distribution, Inc.	6.38%	03/15/2029	8,029	8,251,342	0.1
WESCO Distribution, Inc.	6.63%	03/15/2032	8,126	8,385,289	0.1
WESCO Distribution, Inc.	7.25%	06/15/2028	9,377	9,621,359	0.1
				<u>42,048,092</u>	<u>0.4</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
CSC Holdings LLC	7.50%	04/01/2028	6,112	3,071,527	0.0
National CineMedia, Inc.(k)	5.75%	08/15/2026	6,800	0	0.0
Univision Communications, Inc.	4.50%	05/01/2029	5,371	4,713,831	0.0
Univision Communications, Inc.	7.38%	06/30/2030	18,576	17,823,538	0.1
Virgin Media Secured Finance PLC	4.50%	08/15/2030	6,000	5,295,722	0.0
Ziggo Bond Co. BV	6.00%	01/15/2027	820	817,933	0.0
				<u>31,722,551</u>	<u>0.1</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Embarq Corp.	8.00%	06/01/2036	9,528	4,190,459	0.0
Vmed O2 UK Financing I PLC	7.75%	04/15/2032	11,843	12,059,125	0.1
				<u>16,249,584</u>	<u>0.1</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
				<u>0</u>	<u>0.0</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Viking Cruises Ltd.	5.88%	09/15/2027	USD 12,945	\$ 12,923,468	0.1%
Viking Cruises Ltd.	7.00%	02/15/2029	17,000	17,200,282	0.1
Viking Cruises Ltd.	9.13%	07/15/2031	12,372	13,568,367	0.1
VOC Escrow Ltd.	5.00%	02/15/2028	3,858	3,790,036	0.0
				<u>47,482,153</u>	<u>0.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Miller Homes Group Finco PLC	7.00%	05/15/2029	GBP 17,251	21,781,010	0.1
Miller Homes Group Finco PLC(b)	8.79%	05/15/2028	EUR 10,088	11,228,122	0.1
Travel & Leisure Co.	4.63%	03/01/2030	USD 15,276	14,162,546	0.1
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.25%	05/15/2027	18,930	18,803,587	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	5.13%	10/01/2029	19,690	19,259,496	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	7.13%	02/15/2031	4,769	5,062,576	0.0
				<u>90,297,337</u>	<u>0.5</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Staples, Inc.	12.75%	01/15/2030	25,564	19,729,199	0.1
William Carter Co. (The)	5.63%	03/15/2027	130	129,826	0.0
Wolverine World Wide, Inc.	4.00%	08/15/2029	1,000	853,602	0.0
				<u>20,712,627</u>	<u>0.1</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Bausch Health Americas, Inc.	8.50%	01/31/2027	15,514	11,489,771	0.1
ENERGIE					
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	6.88%	01/15/2029	8,328	8,389,782	0.1
Venture Global Calcasieu Pass LLC	3.88%	11/01/2033	3,818	3,402,494	0.0
Venture Global Calcasieu Pass LLC	4.13%	08/15/2031	12,759	11,834,253	0.1
Venture Global LNG, Inc.	8.13%	06/01/2028	18,516	19,395,992	0.1
Venture Global LNG, Inc.	8.38%	06/01/2031	18,493	19,651,836	0.1
Venture Global LNG, Inc.	9.50%	02/01/2029	11,025	12,424,307	0.1
				<u>75,098,664</u>	<u>0.5</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Monitronics International, Inc.(j) (k)	9.13%	04/01/2020	21,822	0	0.0
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Albion Financing 1 SARL/Aggreko Holdings, Inc.	5.25%	10/15/2026	EUR 9,450	10,483,534	0.1
BCP V Modular Services Finance II PLC	4.75%	11/30/2028	3,116	3,307,333	0.0
BCP V Modular Services Finance PLC	6.75%	11/30/2029	31,430	30,013,223	0.2
				<u>43,804,090</u>	<u>0.3</u>
				<u>413,187,501</u>	<u>2.6</u>
FINANZINSTITUTE					
FINANZEN					
Curo SPV LLC(k)	18.00%	08/02/2027	USD 2,540	2,639,937	0.0
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Vistra Corp.(d)	7.00%	12/15/2026	14,856	14,990,081	0.1
Vistra Corp.(d)	8.00%	10/15/2026	17,732	18,330,414	0.1
				<u>33,320,495</u>	<u>0.2</u>
				<u>449,147,933</u>	<u>2.8</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 13 Ltd., Series 2021-13A, Class E(b)	12.04%	10/20/2034	12,156	12,018,009	0.1
AGL CLO 16 Ltd., Series 2021-16A, Class E(b)	12.39%	01/20/2035	2,900	2,900,119	0.0
Dryden 49 Senior Loan Fund, Series 2017-49A, Class E(b)	11.84%	07/18/2030	3,732	3,444,237	0.0
Elmwood CLO 15 Ltd., Series 2022-2A, Class E(b)	12.53%	04/22/2035	4,200	4,202,902	0.0
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class ER(b)	11.69%	10/20/2030	7,000	6,986,448	0.1
Octagon Investment Partners 30 Ltd., Series 2017-1A, Class D(b)	11.74%	03/17/2030	1,000	928,393	0.0
Pikes Peak CLO 10, Series 2022-10A, Class E(b)	13.22%	04/22/2034	6,150	6,185,990	0.1
Pikes Peak CLO 7, Series 2021-7A, Class ER(b)	12.05%	02/25/2037	2,000	1,928,860	0.0
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class E(b)	12.00%	07/20/2034	8,350	8,364,420	0.1
Wehle Park CLO Ltd., Series 2022-1A, Class E(b)	12.03%	04/21/2035	11,890	11,899,809	0.1
				<u>58,859,187</u>	<u>0.5</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
Grantor Trust CMBSIT(k)	0.00%	11/10/2046	842	11,068,508	0.1
Grantor Trust COMM(k)	0.00%	03/10/2047	469	0	0.0
Grantor Trust CSAIL(k)	4.00%	04/15/2050	1,006	6,815,670	0.1
Grantor Trust JPMBB(k)	4.00%	11/15/2047	1,109	5,282,934	0.0
Grantor Trust WFRBS(k)	3.40%	10/15/2057	581	4,725,987	0.0
GS Mortgage Securities Trust(k)	3.49%	07/10/2046	610	13,116,497	0.1
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-LC9, Class G	3.69%	12/15/2047	13,837	7,561,889	0.1
				<u>48,571,485</u>	<u>0.4</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
SCHWELLENMÄRKTE – LOKALE WÄHRUNG					
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
K201640219 South Africa Ltd.(j) (k)	0.00%	06/25/2023	ZAR 684	\$ 0	0.0%
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
HDFC Bank Ltd.	8.10%	03/22/2025	INR 1,070,000	12,710,446	0.1
INFLATIONSgebundene Wertpapiere					
KOLUMBIEN					
Fideicomiso PA Pacifico Tres	7.00%	01/15/2035	COP 157,792,950	34,249,486	0.2
				46,959,932	0.3
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
ENERGIE					
Var Energi ASA	7.50%	01/15/2028	USD 5,574	5,945,680	0.0
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Lloyds Banking Group PLC(d)	6.00%	06/07/2032	GBP 4,459	5,402,304	0.0
VERSICHERUNGEN					
Nationwide Mutual Insurance Co.	9.38%	08/15/2039	USD 14,895	19,896,251	0.1
REITs					
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	4.63%	06/15/2025	4,985	4,947,444	0.0
				30,245,999	0.1
				36,191,679	0.1
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Braskem Netherlands Finance BV	7.25%	02/13/2033	3,164	3,108,796	0.0
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Digicel Group Holdings Ltd., Series 3ARG	0.00%	12/31/2030	11	5,594	0.0
Digicel Group Holdings Ltd., Series 3BRG	0.00%	12/31/2030	1,375	13,746	0.0
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
K2016470219 South Africa Ltd.(j) (k)	3.00%	12/31/2022	16,758	0	0.0
K2016470260 South Africa Ltd.(j) (k)	25.00%	12/31/2022	11,747	0	0.0
				0	0.0
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
BBFI Liquidating Trust(k)	0.00%	12/30/2099	19,467	5,636,504	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(j) (k)	10.50%	01/28/2018	27,382	2,738	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(j) (k)	10.88%	01/13/2020	8,270	827	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(j) (k)	11.75%	02/09/2022	32,408	162,039	0.0
				5,802,108	0.0
ENERGIE					
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	4.00%	08/15/2026	2,962	2,873,140	0.0
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
JSW Infrastructure Ltd.	4.95%	01/21/2029	2,678	2,577,575	0.0
				14,380,959	0.0
VERSORGBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
AES Andes SA	6.35%	10/07/2079	5,885	5,836,920	0.0
STAATSANLEIHEN					
EL SALVADOR					
El Salvador Government International Bond	7.65%	06/15/2035	1,843	1,443,991	0.0
LIBANON					
Lebanon Government International Bond, Series 8Y(j)	6.65%	04/22/2024	4,315	269,688	0.0
PANAMA					
Panama Notas del Tesoro	3.75%	04/17/2026	7,398	7,131,228	0.0
				8,844,907	0.0
				29,062,786	0.0
VORZUGSAKTIE					
INDUSTRIEGÜTER					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Exide International Holdings LP(k)	0.00%		21,353	22,954,475	0.1

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
STAMMAKTIEN					
AG Tracker(k)			856,180	\$ 1	0.0%
ATD New Holdings, Inc.			525,684	5,361,977	0.0
BIS Industries Holdings Ltd.(k)			10,224,003	10	0.0
CHC Group LLC(k)			262,557	52	0.0
Curo Group Holdings LLC(k)			1,555,530	7,256,151	0.1
Exide Technologies(k)			6,006	2,552,550	0.0
K201640219 South Africa Ltd. - Class A(k)			193,371,375	193	0.0
K201640219 South Africa Ltd. - Class B(k)			30,622,211	31	0.0
New Cotai LLC/New Cotai Capital Corp.(k)			63	0	0.0
Paysafe Ltd.			134,791	3,019,318	0.0
Southeastern Grocers, Inc.(k)			2,258,161	1,637,167	0.0
				<u>19,827,450</u>	<u>0.1</u>
QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
UKRAINE					
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC(k)	7.65%	07/19/2025	USD 4,966	4,295,812	0.0
State Agency of Roads of Ukraine	6.25%	06/24/2030	35,107	10,795,403	0.1
				<u>15,091,215</u>	<u>0.1</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN					
VEREINIGTE STAATEN					
Wisconsin Public Finance Authority, Series 2021	5.75%	07/25/2041	15,000	14,000,042	0.1
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I					
Series 2019-24, Class PT.	0.50%	08/15/2044	18	13,283	0.0
Series 2019-36, Class PT.	10.27%	10/17/2044	95	92,993	0.0
				<u>106,276</u>	<u>0.0</u>
OPTIONSSCHEINE					
FINANZINSTITUTE					
SONSTIGE FINANZWERTE					
Curo Group Holdings LLC, expiring 08/01/2028(k)			364,028	0	0.0
				<u>740,772,460</u>	<u>4.5</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$16,760,174,829)				<u>\$ 15,919,733,621</u>	<u>98.2%</u>
Termineinlagen					
ANZ, Hong Kong(l)	1.71 %	–		1,111,564	0.0
ANZ, Hong Kong(l)	3.44 %	–		39,984	0.0
Citibank, New York(l)	4.68 %	–		157,704,262	0.9
DNB, Oslo(l)	3.05 %	–		341,451	0.0
HSBC, Paris(l)	2.62 %	–		9,456,790	0.1
HSBC, Singapore(l)	2.11 %	–		110,829	0.0
Scotiabank, Toronto(l)	3.30 %	–		12,186,193	0.1
SMBC, London(l)	3.90 %	–		8,316,327	0.1
Standard Chartered Bank, Johannesburg(l)	6.46 %	–		5,705,267	0.0
Termineinlagen insgesamt.				<u>194,972,667</u>	<u>1.2</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten.				<u>99,260,297</u>	<u>0.6</u>
Nettovermögen				<u>\$ 16,213,966,585</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Long					
Euro-BOBL Futures	12/06/2024	2,978	\$ 392,063,048	\$ 391,602,184	\$ (460,863)
U.S. Long Bond (CBT) Futures	12/19/2024	225	27,979,101	27,703,125	(275,977)
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	12/31/2024	4,176	867,976,828	866,715,754	(1,261,074)
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	12/19/2024	80	10,676,523	10,555,000	(121,523)
Short					
U.S. 10 Yr Ultra Futures	12/19/2024	2,614	309,049,156	306,981,625	2,067,531
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	12/31/2024	1,893	207,702,109	207,091,243	610,866
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	12/19/2024	2,844	324,706,227	322,971,750	1,734,477
					<u>\$ 2,293,437</u>
				Wertsteigerung	\$ 4,412,874
				Wertminderung	\$ (2,119,437)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Bank of America NA	EUR 458,682	USD 502,962	10/25/2024	\$ (5,288,990)
Bank of America NA	CAD 19,000	USD 14,018	11/07/2024	(108,365)
Bank of America NA	GBP 68,598	USD 90,835	11/08/2024	705,272
Barclays Bank PLC	INR 1,111,024	USD 13,271	09/13/2024	24,311
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 7,113	USD 7,953	10/25/2024	70,927
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 249	USD 273	10/25/2024	(2,419)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 11,269	EUR 10,187	10/25/2024	18,114
Brown Brothers Harriman & Co. +	AUD 1,553	USD 1,055	09/09/2024	3,716
Brown Brothers Harriman & Co. +	AUD 549,881	USD 361,189	09/09/2024	(11,051,222)
Brown Brothers Harriman & Co. +	CAD 48,464	USD 35,302	09/09/2024	(666,526)
Brown Brothers Harriman & Co. +	CNH 2,936	USD 410	09/09/2024	(4,240)
Brown Brothers Harriman & Co. +	EUR 465	USD 518	09/09/2024	3,711
Brown Brothers Harriman & Co. +	EUR 79,014	USD 86,430	09/09/2024	(931,768)
Brown Brothers Harriman & Co. +	GBP 58	USD 77	09/09/2024	296
Brown Brothers Harriman & Co. +	GBP 43,553	USD 55,411	09/09/2024	(1,790,871)
Brown Brothers Harriman & Co. +	PLN 151	USD 39	09/09/2024	370
Brown Brothers Harriman & Co. +	PLN 12,557	USD 3,177	09/09/2024	(64,173)
Brown Brothers Harriman & Co. +	SGD 1,193	USD 915	09/09/2024	601
Brown Brothers Harriman & Co. +	SGD 91,499	USD 69,060	09/09/2024	(1,079,435)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 727,343	AUD 1,092,250	09/09/2024	12,053,316
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 4,202	AUD 6,192	09/09/2024	(10,271)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 71,065	CAD 97,151	09/09/2024	1,036,049
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 199	CAD 268	09/09/2024	(216)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 47,486	CNH 340,234	09/09/2024	548,719
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 84,863	EUR 77,606	09/09/2024	942,221
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 91,007	EUR 81,735	09/09/2024	(636,569)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 111,532	GBP 86,603	09/09/2024	2,211,103
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 1,137	GBP 862	09/09/2024	(5,484)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 3,136	PLN 12,397	09/09/2024	64,250
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 3,318	PLN 12,753	09/09/2024	(26,067)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 68,889	SGD 91,277	09/09/2024	1,079,282
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 70,870	SGD 92,363	09/09/2024	(68,694)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 462,152	ZAR 8,365,755	09/09/2024	6,884,695
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 7,512	ZAR 133,269	09/09/2024	(39,782)
Brown Brothers Harriman & Co. +	ZAR 883	USD 50	09/09/2024	315
Brown Brothers Harriman & Co. +	ZAR 4,211,203	USD 229,413	09/09/2024	(6,693,925)
Brown Brothers Harriman & Co. +	AUD 1,553	USD 1,055	09/23/2024	3,704
Brown Brothers Harriman & Co. +	AUD 664,688	USD 448,207	09/23/2024	(1,906,017)
Brown Brothers Harriman & Co. +	CHF 253	USD 297	09/23/2024	(2,297)
Brown Brothers Harriman & Co. +	EUR 83,994	USD 93,343	09/23/2024	415,171
Brown Brothers Harriman & Co. +	GBP 28	USD 36	09/23/2024	(297)
Brown Brothers Harriman & Co. +	NZD 314	USD 196	09/23/2024	109
Brown Brothers Harriman & Co. +	NZD 131,187	USD 80,671	09/23/2024	(1,346,213)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 896,542	AUD 1,328,527	09/23/2024	3,108,860
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 4,202	AUD 6,191	09/23/2024	(10,362)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 594	CHF 507	09/23/2024	3,470
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 188,205	EUR 169,131	09/23/2024	(1,084,618)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 72	GBP 55	09/23/2024	565
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 1	GBP 1	09/23/2024	(7)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 162,254	NZD 263,709	09/23/2024	2,614,281
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 36	NZD 58	09/23/2024	(26)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 378,698	ZAR 6,770,355	09/23/2024	453,019
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 7,412	ZAR 131,647	09/23/2024	(39,682)
Brown Brothers Harriman & Co. +	ZAR 3,372,965	USD 188,602	09/23/2024	(289,663)
Brown Brothers Harriman & Co. +	AUD 863	USD 586	09/30/2024	1,732
Brown Brothers Harriman & Co. +	GBP 58	USD 77	09/30/2024	297
Brown Brothers Harriman & Co. +	SGD 140	USD 108	09/30/2024	132
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 506,086	AUD 746,170	09/30/2024	(710,959)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 45,666	CNH 323,912	09/30/2024	179,349
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 2,854	EUR 2,554	09/30/2024	(27,541)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 58,842	GBP 44,571	09/30/2024	(291,705)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 76,747	SGD 99,856	09/30/2024	(104,882)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 1,506	ZAR 26,925	09/30/2024	844
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 410,684	ZAR 7,286,807	09/30/2024	(2,847,451)
Brown Brothers Harriman & Co. +	CAD 29	USD 21	10/01/2024	(14)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 37,477	CAD 50,491	10/01/2024	21,077
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD 199	CAD 268	10/01/2024	(201)
Citibank NA	EUR 34,985	USD 38,355	10/10/2024	(381,361)
Citibank NA	USD 4,677	GBP 3,548	11/08/2024	(14,475)
HSBC Bank USA	EUR 10,689	USD 11,918	10/25/2024	73,190
Morgan Stanley & Co. LLC	COP 337,117,538	USD 84,759	09/12/2024	4,246,594
State Street Bank & Trust Co.	EUR 422,649	USD 455,948	09/25/2024	(11,698,491)
				\$ (12,455,617)
			Wertsteigerung	\$ 36,769,662
			Wertminderung	\$ (49,225,279)

+ Zur Absicherung des Portfolios oder der Anteilklassen.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nomineller Betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Verkaufskontrakte					
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 42, 5 Year Index, 06/20/2029	06/20/2029	USD 1,070,050	\$ 76,518,879	\$ 9,415,756
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	Hertz Corp. (The), 5.000%, 12/01/2029, 06/20/2029	06/20/2029	USD 8,080	(3,091,299)	(1,893,956)
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	iTraxx-XOVER Series 41, 5 Year Index, 06/20/2029	06/20/2029	EUR 312,730	30,000,111	1,554,083
Insgesamt				<u>\$ 103,427,691</u>	<u>\$ 9,075,883</u>
				Wertsteigerung	\$ 10,969,839
				Wertminderung	\$ (1,893,956)

- (a) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (b) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 30. August 2024.
- (c) Wandelbares Wertpapier.
- (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 30. August 2024.
- (f) Not leidend.
- (g) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für offene OTC-Derivate zu dienen.
- (h) Kredit, bei dem bis zur Endfälligkeit nur Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (i) Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (j) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (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
- BOBL – Bundesobligation
- CAB – Capital Appreciation Bond
- CBT – Chicago Board of Trade
- CDX-NAHY – North American High Yield Credit Default Swap Index
- CJSC – Closed Joint Stock Company
- CLO – Collateralized Loan Obligations
- CMBS – Commercial Mortgage-Backed Securities
- INTRCONX – Intercontinental Exchange
- JSC – Joint Stock Company
- REIT – Real Estate Investment Trust
- REMICS – Real Estate Mortgage Investment Conduits

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Bonds	4.38%	08/15/2043	USD 180,000	\$ 182,081,250	0.7%
U.S. Treasury Bonds	4.50%	02/15/2044	188,566	193,662,754	0.7
U.S. Treasury Bonds	4.63%	05/15/2044	35,534	37,076,986	0.1
U.S. Treasury Bonds(a)	6.13%	11/15/2027	344,064	367,718,827	1.4
U.S. Treasury Bonds(a)	6.13%	08/15/2029	387,115	427,882,496	1.6
U.S. Treasury Bonds	6.25%	05/15/2030	747,077	839,994,927	3.1
U.S. Treasury Bonds	6.75%	08/15/2026	13,643	14,357,021	0.1
U.S. Treasury Bonds	7.63%	02/15/2025	217,311	220,264,778	0.8
U.S. Treasury Notes	3.50%	02/15/2033	74,450	72,449,156	0.3
U.S. Treasury Notes	3.75%	12/31/2028	137,000	136,978,601	0.5
U.S. Treasury Notes	3.88%	08/15/2033	51,839	51,758,002	0.2
U.S. Treasury Notes	4.00%	07/31/2029	110,000	111,306,250	0.4
U.S. Treasury Notes	4.00%	02/15/2034	89,650	90,294,359	0.3
U.S. Treasury Notes	4.13%	07/31/2028	564,294	571,700,055	2.1
U.S. Treasury Notes	4.25%	02/28/2029	197,650	201,850,062	0.7
U.S. Treasury Notes	4.38%	11/30/2028	210,000	215,053,125	0.8
U.S. Treasury Notes	4.38%	05/15/2034	58,400	60,553,500	0.2
U.S. Treasury Notes	4.50%	04/15/2027	451,100	458,500,837	1.7
U.S. Treasury Notes	4.50%	11/15/2033	83,700	87,558,051	0.3
U.S. Treasury Notes	4.63%	06/30/2025	109,870	109,972,803	0.4
U.S. Treasury Notes	4.63%	06/30/2026	137,600	139,105,000	0.5
U.S. Treasury Notes	4.63%	09/30/2028	251,450	259,622,125	1.0
U.S. Treasury Notes	4.63%	04/30/2029	442,000	458,505,960	1.7
U.S. Treasury Notes	4.88%	11/30/2025	229,263	230,982,775	0.9
U.S. Treasury Notes	4.88%	10/31/2028	363,839	379,359,198	1.4
U.S. Treasury Notes	5.00%	10/31/2025	69,459	69,990,792	0.3
				<u>5,988,579,690</u>	<u>22.2</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
AngloGold Ashanti Holdings PLC	3.38%	11/01/2028	24,782	23,000,918	0.1
CF Industries, Inc.	5.15%	03/15/2034	367	365,590	0.0
Equate Sukuk Spc Ltd.	5.00%	09/05/2031	10,215	10,112,339	0.0
Glencore Funding LLC	5.37%	04/04/2029	24,757	25,275,702	0.1
Glencore Funding LLC	6.38%	10/06/2030	33,738	36,075,677	0.1
Huntsman International LLC	4.50%	05/01/2029	13,936	13,571,113	0.1
MEGlobal Canada ULC	5.00%	05/18/2025	5,875	5,846,506	0.0
MEGlobal Canada ULC	5.88%	05/18/2030	3,112	3,227,727	0.0
Olin Corp.	5.63%	08/01/2029	10,044	10,005,541	0.0
Rohm & Haas Co.	7.85%	07/15/2029	16,500	18,618,321	0.1
				<u>146,099,434</u>	<u>0.5</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Boeing Co. (The)	3.25%	02/01/2028	17,808	16,777,746	0.1
Boeing Co. (The)	3.63%	02/01/2031	15,489	14,030,955	0.1
Boeing Co. (The)	5.15%	05/01/2030	13,293	13,258,064	0.1
Boeing Co. (The)	6.30%	05/01/2029	28,213	29,462,399	0.1
Boeing Co. (The)	6.53%	05/01/2034	40,499	42,917,376	0.2
Regal Rexnord Corp.	6.30%	02/15/2030	7,050	7,432,752	0.0
Rolls-Royce PLC	3.63%	10/14/2025	2,000	1,962,074	0.0
Rolls-Royce PLC	5.75%	10/15/2027	2,000	2,052,904	0.0
				<u>127,894,270</u>	<u>0.6</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	6.10%	06/01/2029	6,243	6,448,690	0.0
DIRECTV Financing LLC	8.88%	02/01/2030	26,286	26,677,611	0.1
DIRECTV Financing LLC/Directv Financing Co-Obligor, Inc.	5.88%	08/15/2027	28,188	27,288,520	0.1
Discovery Communications LLC	4.13%	05/15/2029	13,000	12,132,753	0.0
Discovery Communications LLC	4.90%	03/11/2026	2,255	2,241,974	0.0
Paramount Global	4.20%	06/01/2029	4,398	4,133,726	0.0
Paramount Global	4.20%	05/19/2032	12,935	11,244,507	0.0
Paramount Global	4.95%	01/15/2031	28,773	26,781,986	0.1
Paramount Global	5.50%	05/15/2033	7,927	7,278,254	0.0
Paramount Global	6.88%	04/30/2036	8,810	8,799,561	0.0
Paramount Global	7.88%	07/30/2030	13,437	14,606,444	0.1
Time Warner Cable Enterprises LLC	8.38%	07/15/2033	15,020	17,113,368	0.1
Warnermedia Holdings, Inc.	3.64%	03/15/2025	10,500	10,395,738	0.0
Warnermedia Holdings, Inc.	3.76%	03/15/2027	56,782	54,398,381	0.2
Warnermedia Holdings, Inc.	4.28%	03/15/2032	19,532	17,075,969	0.1
				<u>246,617,482</u>	<u>0.8</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
AT&T, Inc.	4.50%	05/15/2035	USD 15,834	\$ 15,101,925	0.1%
AT&T, Inc.	7.13%	12/15/2031	3,042	3,349,173	0.0
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC.	4.74%	03/20/2025	2,671	2,666,353	0.0
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC.	5.15%	03/20/2028	6,855	6,891,307	0.0
				<u>28,008,758</u>	<u>0.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Ford Motor Co.	3.25%	02/12/2032	96,201	82,051,465	0.3
Ford Motor Credit Co. LLC.	2.90%	02/16/2028	2,258	2,089,256	0.0
Ford Motor Credit Co. LLC.	5.85%	05/17/2027	6,005	6,105,409	0.0
Ford Motor Credit Co. LLC.	6.05%	03/05/2031	20,370	20,912,933	0.1
Ford Motor Credit Co. LLC.	6.13%	03/08/2034	10,222	10,349,919	0.0
Ford Motor Credit Co. LLC.	6.80%	05/12/2028	9,926	10,414,371	0.0
General Motors Co.	6.25%	10/02/2043	7,450	7,749,907	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	2.35%	01/08/2031	11,552	9,818,141	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	2.70%	06/10/2031	37,715	32,459,688	0.1
General Motors Financial Co., Inc.	3.60%	06/21/2030	5,775	5,363,685	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	5.60%	06/18/2031	5,396	5,522,088	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	5.75%	02/08/2031	12,430	12,834,659	0.1
General Motors Financial Co., Inc.	5.80%	06/23/2028	28,660	29,608,527	0.1
General Motors Financial Co., Inc.	5.80%	01/07/2029	21,015	21,756,742	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.35%	06/08/2025	10,525	10,344,549	0.0
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	5.95%	06/11/2029	20,379	20,837,769	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	6.50%	03/10/2028	46,611	48,487,264	0.2
Hyundai Capital America.	2.00%	06/15/2028	7,146	6,480,283	0.0
Hyundai Capital America.	5.25%	01/08/2027	14,359	14,535,734	0.1
Hyundai Capital America.	5.30%	01/08/2029	5,855	5,969,873	0.0
Hyundai Capital America.	5.68%	06/26/2028	46,933	48,360,882	0.2
Hyundai Capital America.	6.20%	09/21/2030	6,489	6,939,167	0.0
Hyundai Capital America.	6.50%	01/16/2029	17,068	18,175,106	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC.	4.50%	10/01/2027	1,000	979,438	0.0
Jaguar Land Rover Automotive PLC.	5.50%	07/15/2029	22,261	22,206,194	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC.	5.88%	01/15/2028	20,920	20,979,251	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC.	7.75%	10/15/2025	34,461	34,613,124	0.1
Lear Corp.	3.50%	05/30/2030	7,020	6,546,088	0.0
Nissan Motor Acceptance Co. LLC.	1.85%	09/16/2026	799	744,754	0.0
Nissan Motor Acceptance Co. LLC.	2.45%	09/15/2028	1,550	1,377,182	0.0
Nissan Motor Co., Ltd.	4.35%	09/17/2027	22,428	21,761,333	0.1
Nissan Motor Co., Ltd.	4.81%	09/17/2030	22,926	21,678,898	0.1
				<u>568,053,679</u>	<u>2.0</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	4.00%	08/01/2028	15,272	14,543,230	0.1
Hasbro, Inc.	6.05%	05/14/2034	18,025	18,678,707	0.1
Mattel, Inc.	3.75%	04/01/2029	10,407	9,897,724	0.0
Mattel, Inc.	5.45%	11/01/2041	8,681	8,126,352	0.0
				<u>51,246,013</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Flutter Treasury Designated Activity Co.	6.38%	04/29/2029	18,931	19,504,141	0.1
Genting New York LLC/GENNY Capital, Inc.	3.30%	02/15/2026	17,897	17,311,636	0.1
International Game Technology PLC.	5.25%	01/15/2029	3,337	3,290,977	0.0
International Game Technology PLC.	6.25%	01/15/2027	35,757	36,324,784	0.1
Las Vegas Sands Corp.	3.90%	08/08/2029	1,571	1,470,957	0.0
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	3,723	3,913,403	0.0
Owens Corning.	7.00%	12/01/2036	1,449	1,675,481	0.0
PulteGroup, Inc.	6.38%	05/15/2033	6,352	6,909,685	0.0
Resorts World Las Vegas LLC/RWLV Capital, Inc.	4.63%	04/16/2029	1,700	1,529,944	0.0
Resorts World Las Vegas LLC/RWLV Capital, Inc.	4.63%	04/06/2031	20,600	17,858,277	0.1
Sands China Ltd.	2.85%	03/08/2029	8,050	7,207,476	0.0
Sands China Ltd.	5.40%	08/08/2028	20,317	20,268,239	0.1
				<u>137,265,000</u>	<u>0.5</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
AutoZone, Inc.	5.40%	07/15/2034	34,347	35,158,755	0.1
Macy's Retail Holdings LLC.	5.88%	04/01/2029	15,172	14,811,491	0.1
Macy's Retail Holdings LLC.	5.88%	03/15/2030	4,040	3,919,693	0.0
Tapestry, Inc.	7.00%	11/27/2026	24,040	24,802,745	0.1
				<u>78,692,684</u>	<u>0.3</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Altria Group, Inc.	2.45%	02/04/2032	14,769	12,425,365	0.1
Altria Group, Inc.	4.80%	02/14/2029	25,806	25,942,432	0.1
BAT Capital Corp.	7.75%	10/19/2032	11,741	13,706,532	0.1
BAT International Finance PLC.	4.45%	03/16/2028	36,222	35,948,072	0.1
Charles River Laboratories International, Inc.	4.00%	03/15/2031	850	782,450	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Charles River Laboratories International, Inc.....	4.25%	05/01/2028	USD 2,000	\$ 1,931,789	0.0%
CVS Health Corp.	5.55%	06/01/2031	89,749	92,271,468	0.3
HCA, Inc.	3.63%	03/15/2032	16,132	14,666,398	0.1
Imperial Brands Finance PLC	3.88%	07/26/2029	3,000	2,862,655	0.0
Imperial Brands Finance PLC	5.50%	02/01/2030	56,244	57,465,583	0.2
IQVIA, Inc.	6.25%	02/01/2029	23,393	24,717,479	0.1
Jazz Securities DAC	4.38%	01/15/2029	3,465	3,301,757	0.0
Philip Morris International, Inc.....	5.50%	09/07/2030	68,020	71,314,794	0.3
Philip Morris International, Inc.....	5.63%	11/17/2029	13,881	14,611,348	0.1
Pilgrim's Pride Corp.	4.25%	04/15/2031	6,202	5,828,665	0.0
				<u>377,776,787</u>	<u>1.5</u>
ENERGIE					
Cenovus Energy, Inc.	6.75%	11/15/2039	191	213,553	0.0
Cheniere Energy Partners LP.....	4.50%	10/01/2029	4,266	4,173,308	0.0
Columbia Pipelines Operating Co. LLC	6.04%	11/15/2033	7,993	8,438,246	0.0
Continental Resources, Inc./OK	2.88%	04/01/2032	4,361	3,669,980	0.0
Continental Resources, Inc./OK	5.75%	01/15/2031	12,069	12,243,345	0.1
Energy Transfer LP	8.25%	11/15/2029	11,355	13,049,058	0.1
EnLink Midstream LLC.....	5.63%	01/15/2028	12,000	12,223,815	0.0
EnLink Midstream LLC.....	6.50%	09/01/2030	23,960	25,607,462	0.1
EnLink Midstream Partners LP	5.05%	04/01/2045	12,996	11,396,017	0.0
EnLink Midstream Partners LP	5.45%	06/01/2047	10,303	9,460,985	0.0
EnLink Midstream Partners LP	5.60%	04/01/2044	1,916	1,791,594	0.0
EQM Midstream Partners LP.....	4.50%	01/15/2029	18,035	17,480,815	0.1
EQM Midstream Partners LP.....	4.75%	01/15/2031	18,166	17,501,876	0.1
EQM Midstream Partners LP.....	5.50%	07/15/2028	2,000	2,016,091	0.0
EQM Midstream Partners LP.....	6.38%	04/01/2029	9,276	9,533,124	0.0
EQM Midstream Partners LP.....	6.50%	07/15/2048	850	878,185	0.0
Hess Corp.	7.30%	08/15/2031	27,309	31,155,220	0.1
Hess Corp.	7.88%	10/01/2029	16,239	18,537,538	0.1
Kinder Morgan, Inc., Series G	7.80%	08/01/2031	3,000	3,466,093	0.0
Marathon Oil Corp.	4.40%	07/15/2027	201	200,281	0.0
Marathon Oil Corp.	6.80%	03/15/2032	10,144	11,307,287	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	5.20%	08/01/2029	36,605	37,137,836	0.1
Occidental Petroleum Corp.....	5.38%	01/01/2032	38,119	38,637,203	0.1
Ovintiv, Inc.	6.25%	07/15/2033	18,012	19,035,607	0.1
Ovintiv, Inc.	6.50%	02/01/2038	8,063	8,543,216	0.0
Targa Resources Corp.....	4.20%	02/01/2033	3,000	2,795,050	0.0
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025	21,298	21,057,611	0.1
Williams Cos., Inc. (The).....	5.15%	03/15/2034	13,464	13,529,741	0.1
				<u>355,080,137</u>	<u>1.2</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
LKQ Corp.	6.25%	06/15/2033	30,373	31,928,661	0.1
Ritchie Bros Holdings, Inc.	6.75%	03/15/2028	9,174	9,450,816	0.0
				<u>41,379,477</u>	<u>0.1</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Boost Newco Borrower LLC.....	7.50%	01/15/2031	55,646	59,376,126	0.2
TECHNOLOGIE					
Broadcom, Inc.....	5.15%	11/15/2031	17,962	18,355,184	0.1
Entegris, Inc.	4.75%	04/15/2029	35,879	35,167,333	0.1
Fiserv, Inc.	5.35%	03/15/2031	38,221	39,637,769	0.2
Jabil, Inc.	3.00%	01/15/2031	3,000	2,641,784	0.0
Jabil, Inc.	5.45%	02/01/2029	7,111	7,242,025	0.0
Leidos, Inc.....	7.13%	07/01/2032	2,000	2,213,364	0.0
SK Hynix, Inc.	5.50%	01/16/2029	17,800	18,226,488	0.1
Western Digital Corp.	2.85%	02/01/2029	6,601	5,917,082	0.0
Western Digital Corp.	3.10%	02/01/2032	2,576	2,166,985	0.0
				<u>131,568,014</u>	<u>0.5</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.75%	10/20/2028	31,075	30,800,578	0.1
Mileage Plus Holdings LLC/Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd.	6.50%	06/20/2027	35,489	35,811,606	0.1
				<u>66,612,184</u>	<u>0.2</u>
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN					
BNSF Funding Trust I	6.61%	12/15/2055	5,597	5,628,280	0.0
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
AerCap Global Aviation Trust	6.50%	06/15/2045	24,752	24,705,588	0.1
ERAC USA Finance LLC	4.60%	05/01/2028	23,757	23,869,776	0.1
ERAC USA Finance LLC	4.90%	05/01/2033	54,939	55,260,284	0.2
				<u>103,835,648</u>	<u>0.4</u>
				<u>2,525,133,973</u>	<u>9.1</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Ally Financial, Inc.	6.85%	01/03/2030	USD 28,108	\$ 29,736,518	0.1%
Ally Financial, Inc.	6.99%	06/13/2029	15,439	16,380,503	0.1
Ally Financial, Inc.	7.10%	11/15/2027	19,842	21,084,261	0.1
Ally Financial, Inc.	8.00%	11/01/2031	8,759	9,976,535	0.0
Ally Financial, Inc.	8.00%	11/01/2031	20,968	23,944,958	0.1
Australia & New Zealand Banking Group Ltd./ United Kingdom(b)	6.75%	06/15/2026	43,923	44,691,652	0.2
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	5.38%	03/13/2029	34,400	35,544,763	0.1
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	7.88%	11/15/2034	6,600	7,514,817	0.0
Banco Santander SA	4.18%	03/24/2028	13,200	12,985,562	0.1
Banco Santander SA	5.18%	11/19/2025	30,600	30,588,036	0.1
Banco Santander SA	5.55%	03/14/2028	18,400	18,686,386	0.1
Banco Santander SA	6.92%	08/08/2033	31,600	34,387,444	0.1
Banco Santander SA(b)	9.63%	05/21/2033	12,400	14,393,095	0.1
Bank Leumi Le-Israel BM	7.13%	07/18/2033	11,750	11,711,770	0.0
Bank of America Corp.	2.97%	02/04/2033	12,974	11,442,177	0.0
Bank of America Corp., Series B	8.05%	06/15/2027	34,006	36,692,789	0.1
Bank of America Corp., Series X(b)	6.25%	09/05/2024	5,657	5,657,000	0.0
Bank of Ireland Group PLC	5.60%	03/20/2030	20,463	20,984,117	0.1
Bank of Ireland Group PLC	6.25%	09/16/2026	11,177	11,304,906	0.0
Barclays PLC	5.09%	06/20/2030	6,644	6,616,061	0.0
Barclays PLC	5.67%	03/12/2028	6,924	7,069,783	0.0
Barclays PLC(b)	6.13%	12/15/2025	56,173	55,683,307	0.2
Barclays PLC	7.12%	06/27/2034	5,402	5,950,404	0.0
BNP Paribas SA	5.50%	05/20/2030	59,244	60,740,420	0.2
BPCE SA	4.50%	03/15/2025	13,000	12,908,462	0.1
BPCE SA	4.88%	04/01/2026	5,000	4,967,310	0.0
BPCE SA	5.98%	01/18/2027	12,618	12,778,823	0.1
CaixaBank SA	5.67%	03/15/2030	30,395	31,314,744	0.1
CaixaBank SA	6.84%	09/13/2034	30,915	34,066,460	0.1
Capital One Financial Corp.	5.70%	02/01/2030	14,031	14,450,614	0.1
Capital One Financial Corp.	5.82%	02/01/2034	9,700	9,909,556	0.0
Capital One Financial Corp.	6.38%	06/08/2034	12,559	13,331,452	0.1
Capital One Financial Corp.	7.62%	10/30/2031	30,590	34,528,712	0.1
Citigroup, Inc.	5.83%	02/13/2035	12,080	12,418,095	0.1
Citigroup, Inc., Series AA(b)	7.63%	11/15/2028	8,569	9,063,577	0.0
Citigroup, Inc., Series P(b)	5.95%	05/15/2025	10,465	10,444,839	0.0
Citigroup, Inc., Series U(b)	5.00%	09/12/2024	26,500	26,466,627	0.1
Citigroup, Inc., Series V(b)	4.70%	01/30/2025	9,977	9,900,587	0.0
Citigroup, Inc., Series W(b)	4.00%	12/10/2025	16,145	15,679,695	0.1
Citigroup, Inc., Series X(b)	3.88%	02/18/2026	24,915	23,890,519	0.1
Danske Bank A/S	4.30%	04/01/2028	27,000	26,698,181	0.1
Deutsche Bank AG/New York NY	3.96%	11/26/2025	11,625	11,578,659	0.0
Deutsche Bank AG/New York NY	6.12%	07/14/2026	24,309	24,451,215	0.1
Deutsche Bank AG/New York NY	6.72%	01/18/2029	17,431	18,349,002	0.1
Deutsche Bank AG/New York NY	6.82%	11/20/2029	4,865	5,185,507	0.0
Deutsche Bank AG/New York NY	7.08%	02/10/2034	15,946	16,871,008	0.1
Deutsche Bank AG/New York NY	7.15%	07/13/2027	10,286	10,674,582	0.0
Discover Bank	5.97%	08/09/2028	42,248	43,404,794	0.2
Dresdner Funding Trust I	8.15%	06/30/2031	11,620	12,781,128	0.1
First-Citizens Bank & Trust Co.	2.97%	09/27/2025	2,736	2,729,822	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	5.73%	04/25/2030	23,802	24,799,194	0.1
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(b) (c)	8.24%	09/30/2024	5,804	5,814,530	0.0
HSBC Holdings PLC	4.76%	03/29/2033	17,054	16,446,657	0.1
HSBC Holdings PLC	5.55%	03/04/2030	38,315	39,441,686	0.2
HSBC Holdings PLC	5.73%	05/17/2032	3,135	3,261,421	0.0
HSBC Holdings PLC	5.89%	08/14/2027	3,464	3,537,121	0.0
HSBC Holdings PLC(b)	6.38%	03/30/2025	9,850	9,850,000	0.0
HSBC Holdings PLC(b)	6.50%	03/23/2028	19,335	19,461,277	0.1
HSBC Holdings PLC	7.40%	11/13/2034	17,987	20,205,293	0.1
HSBC Holdings PLC	8.11%	11/03/2033	10,861	12,681,423	0.1
Intesa Sanpaolo SpA	4.20%	06/01/2032	850	746,529	0.0
Intesa Sanpaolo SpA	5.71%	01/15/2026	3,000	3,009,759	0.0
Intesa Sanpaolo SpA	8.25%	11/21/2033	4,500	5,150,784	0.0
JPMorgan Chase & Co.	2.96%	01/25/2033	29,736	26,315,799	0.1
Lloyds Banking Group PLC	4.58%	12/10/2025	22,665	22,498,380	0.1
Lloyds Banking Group PLC	4.98%	08/11/2033	1,109	1,104,041	0.0
Lloyds Banking Group PLC	5.46%	01/05/2028	5,508	5,600,463	0.0
Lloyds Banking Group PLC	5.87%	03/06/2029	16,838	17,466,841	0.1
Lloyds Banking Group PLC	5.99%	08/07/2027	3,428	3,505,384	0.0
Lloyds Banking Group PLC(b)	7.50%	09/27/2025	6,303	6,344,779	0.0
Lloyds Banking Group PLC	7.95%	11/15/2033	9,407	10,870,827	0.0
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	5.02%	07/20/2028	19,113	19,374,944	0.1
Mizuho Financial Group, Inc.	2.87%	09/13/2030	5,800	5,311,599	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Mizuho Financial Group, Inc.	5.38%	05/26/2030	USD 22,525	\$ 23,167,027	0.1%
Mizuho Financial Group, Inc.	5.38%	07/10/2030	19,046	19,592,417	0.1
Morgan Stanley	5.42%	07/21/2034	10,214	10,492,450	0.0
Morgan Stanley	5.66%	04/18/2030	49,047	51,048,012	0.2
Nationwide Building Society	6.56%	10/18/2027	77,774	80,645,392	0.3
NatWest Group PLC	3.03%	11/28/2035	4,891	4,309,766	0.0
NatWest Group PLC	6.48%	06/01/2034	8,193	8,568,716	0.0
NatWest Group PLC(b)	8.13%	11/10/2033	7,815	8,251,096	0.0
NatWest Markets PLC	5.41%	05/17/2029	52,850	54,527,677	0.2
Nordea Bank Abp(b)	3.75%	03/01/2029	2,800	2,417,506	0.0
Nordea Bank Abp(b)	6.63%	03/26/2026	59,046	59,271,077	0.2
PNC Bank NA	5.90%	04/01/2026	7,500	7,472,775	0.0
Santander Holdings USA, Inc.	5.81%	09/09/2026	7,436	7,462,604	0.0
Santander Holdings USA, Inc.	6.17%	01/09/2030	18,906	19,583,997	0.1
Santander Holdings USA, Inc.	6.50%	03/09/2029	2,012	2,098,297	0.0
Santander Holdings USA, Inc.	6.57%	06/12/2029	1,819	1,903,426	0.0
Santander UK Group Holdings PLC	6.83%	11/21/2026	13,433	13,705,344	0.1
Skandinaviska Enskilda Banken AB(b)	6.88%	06/30/2027	600	606,196	0.0
Societe Generale SA	4.25%	04/14/2025	11,148	11,043,968	0.0
Societe Generale SA	4.75%	11/24/2025	8,700	8,618,860	0.0
Societe Generale SA	4.75%	11/24/2025	13,412	13,286,914	0.1
Societe Generale SA	5.52%	01/19/2028	74,175	74,716,320	0.3
Societe Generale SA	6.45%	01/12/2027	6,504	6,601,846	0.0
Standard Chartered PLC	2.82%	01/30/2026	17,000	16,815,619	0.1
Standard Chartered PLC	6.17%	01/09/2027	22,777	23,124,119	0.1
Standard Chartered PLC	6.19%	07/06/2027	8,683	8,886,205	0.0
Standard Chartered PLC(b) (c)	7.03%	01/30/2027	19,013	18,041,016	0.1
Standard Chartered PLC(b) (c)	7.03%	01/30/2027	15,000	14,233,169	0.1
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	5.42%	07/09/2031	52,563	54,548,955	0.2
Svenska Handelsbanken AB(b)	4.38%	03/01/2027	1,800	1,714,585	0.0
Svenska Handelsbanken AB(b)	4.75%	03/01/2031	13,600	12,163,002	0.0
Swedbank AB, Series NC5(b)	5.63%	09/17/2024	13,600	13,598,304	0.1
Synchrony Financial	5.94%	08/02/2030	24,477	24,921,390	0.1
UBS Group AG	2.10%	02/11/2032	26,000	21,781,739	0.1
UBS Group AG	3.09%	05/14/2032	16,971	15,061,274	0.1
UBS Group AG	4.49%	05/12/2026	4,473	4,450,909	0.0
UBS Group AG	5.62%	09/13/2030	14,686	15,225,909	0.1
UBS Group AG(b)	7.00%	02/19/2025	30,847	30,884,245	0.1
UBS Group AG	9.02%	11/15/2033	4,000	4,981,428	0.0
UBS Group AG(b)	9.25%	11/13/2028	7,384	8,142,400	0.0
UBS Group AG(b)	9.25%	11/13/2033	7,080	8,168,610	0.0
Wells Fargo & Co.	5.50%	01/23/2035	18,726	19,303,170	0.1
Wells Fargo & Co.	5.71%	04/22/2028	37,544	38,553,768	0.1
				<u>2,109,401,464</u>	<u>7.8</u>
MAKLER					
Joy Treasure Assets Holdings, Inc.	3.50%	09/24/2029	17,500	16,037,175	0.1
FINANZEN					
Aircastle Ltd.	2.85%	01/26/2028	20,004	18,510,023	0.1
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	25,957	25,884,402	0.1
Aircastle Ltd.(b)	5.25%	06/15/2026	14,497	14,226,720	0.1
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	5,354	5,123,152	0.0
Aviation Capital Group LLC	1.95%	09/20/2026	13,175	12,387,099	0.1
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	5,647	5,412,884	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	117	115,655	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	4,985	4,954,243	0.0
Aviation Capital Group LLC	5.50%	12/15/2024	30,672	30,594,761	0.1
				<u>117,208,939</u>	<u>0.5</u>
VERSICHERUNGEN					
ACE Capital Trust II	9.70%	04/01/2030	31,826	38,678,420	0.1
Allstate Corp. (The)	6.50%	05/15/2057	8,665	8,984,747	0.0
Allstate Corp. (The), Series B(d)	8.32%	08/15/2053	35,856	35,832,625	0.1
Argentum Netherlands BV for Swiss Re Ltd.	5.63%	08/15/2052	21,351	21,334,420	0.1
Argentum Netherlands BV for Swiss Re Ltd.	5.75%	08/15/2050	18,619	18,625,238	0.1
Athene Global Funding	1.99%	08/19/2028	18,760	16,849,885	0.1
Athene Global Funding	2.55%	11/19/2030	22,269	19,407,890	0.1
Athene Global Funding	2.72%	01/07/2029	20,988	19,189,911	0.1
Athene Global Funding	5.53%	07/11/2031	2,577	2,636,795	0.0
Athene Global Funding	5.58%	01/09/2029	39,561	40,679,282	0.2
Cloverie PLC for Zurich Insurance Co., Ltd., Series E	5.63%	06/24/2046	3,300	3,293,341	0.0
Hartford Financial Services Group, Inc. (The), Series ICON(c)	7.50%	02/12/2047	61,341	55,361,595	0.2
Humana, Inc.	5.38%	04/15/2031	26,154	26,795,725	0.1
Liberty Mutual Group, Inc.	7.80%	03/15/2037	6,501	7,041,074	0.0
MetLife Capital Trust IV	7.88%	12/15/2037	11,997	13,175,188	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
MetLife, Inc.	10.75%	08/01/2039	USD 8,590	\$ 11,709,065	0.0%
Nationwide Mutual Insurance Co.(c)	7.89%	12/15/2024	1,000	1,003,856	0.0
Swiss Re Finance Luxembourg SA	5.00%	04/02/2049	5,000	4,998,212	0.0
Swiss Re Finance Luxembourg SA	5.00%	04/02/2049	290	289,896	0.0
Swiss RE Subordinated Finance PLC	5.70%	04/05/2035	35,200	36,188,404	0.1
				<u>382,075,569</u>	<u>1.4</u>
REITs					
American Tower Corp.....	2.10%	06/15/2030	14,865	12,930,512	0.1
American Tower Corp.....	5.20%	02/15/2029	21,414	21,893,700	0.1
Boston Properties LP	6.75%	12/01/2027	19,653	20,558,035	0.1
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.....	5.25%	06/01/2025	14,960	14,932,851	0.1
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.....	5.38%	04/15/2026	5,190	5,194,392	0.0
Newmark Group, Inc.	7.50%	01/12/2029	13,332	14,180,467	0.1
Store Capital Corp.....	4.63%	03/15/2029	4,573	4,447,488	0.0
				<u>94,137,445</u>	<u>0.5</u>
				<u>2,718,860,592</u>	<u>10.3</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Alexander Funding Trust II	7.47%	07/31/2028	16,601	17,855,723	0.1
American Electric Power Co., Inc.	6.95%	12/15/2054	15,328	15,958,003	0.1
Electricite de France SA(b)	9.13%	03/15/2033	8,329	9,398,532	0.0
Enel Finance International NV	5.13%	06/26/2029	56,420	57,316,536	0.2
Israel Electric Corp., Ltd.	7.75%	12/15/2027	8,777	9,296,946	0.0
Israel Electric Corp., Ltd., Series G	4.25%	08/14/2028	37,359	35,421,189	0.1
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	6.70%	09/01/2054	11,521	11,753,646	0.0
NRG Energy, Inc.	7.00%	03/15/2033	15,378	16,876,140	0.1
Pacific Gas & Electric Co.	5.55%	05/15/2029	13,877	14,282,768	0.1
PacifiCorp	5.10%	02/15/2029	8,955	9,181,332	0.0
Palomino Funding Trust I	7.23%	05/17/2028	28,733	30,694,472	0.1
				<u>228,035,287</u>	<u>0.8</u>
				<u>5,472,029,852</u>	<u>20.2</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
ASP Unifrax Holdings, Inc.	5.25%	09/30/2028	21,002	10,870,970	0.0
Axalta Coating Systems LLC	3.38%	02/15/2029	2,850	2,650,220	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	7.00%	03/15/2032	26,695	26,817,470	0.1
CVR Partners LP/CVR Nitrogen Finance Corp.	6.13%	06/15/2028	31,221	30,343,862	0.1
Element Solutions, Inc.	3.88%	09/01/2028	12,362	11,698,539	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	4.38%	04/01/2031	9,000	8,212,890	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	4.50%	09/15/2027	9,423	9,078,496	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	5.88%	04/15/2030	2,400	2,385,319	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	6.13%	04/15/2032	52,506	52,425,391	0.2
Graphic Packaging International LLC	4.75%	07/15/2027	4,299	4,231,749	0.0
Graphic Packaging International LLC	6.38%	07/15/2032	15,783	16,135,925	0.1
INEOS Finance PLC	7.50%	04/15/2029	44,002	45,571,268	0.2
INEOS Quattro Finance 2 PLC	9.63%	03/15/2029	19,565	21,023,183	0.1
Ingevity Corp.	3.88%	11/01/2028	5,400	5,006,880	0.0
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc./Intelligent Packaging Ltd. Co-Issuer LLC	6.00%	09/15/2028	27,796	27,373,874	0.1
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	5.38%	11/01/2026	34,921	34,332,535	0.1
Sealed Air Corp./Sealed Air Corp. US.	6.13%	02/01/2028	8,825	8,982,376	0.0
Vallourec SACA.	7.50%	04/15/2032	14,841	15,643,981	0.1
				<u>332,784,928</u>	<u>1.1</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Arcosa, Inc.	6.88%	08/15/2032	5,327	5,553,646	0.0
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/ Ardagh Metal Packaging Finance PLC	6.00%	06/15/2027	3,559	3,550,103	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	4.13%	08/15/2026	4,000	3,447,345	0.0
Ball Corp.	2.88%	08/15/2030	1,000	883,378	0.0
Ball Corp.	6.00%	06/15/2029	19,332	19,890,651	0.1
Bombardier, Inc.	6.00%	02/15/2028	1,678	1,678,221	0.0
Bombardier, Inc.	7.00%	06/01/2032	7,468	7,764,866	0.0
Bombardier, Inc.	7.25%	07/01/2031	11,054	11,608,657	0.0
Bombardier, Inc.	7.45%	05/01/2034	12,081	13,177,610	0.1
Bombardier, Inc.	7.50%	02/01/2029	4,855	5,094,634	0.0
Bombardier, Inc.	8.75%	11/15/2030	6,000	6,555,858	0.0
Clean Harbors, Inc.	5.13%	07/15/2029	4,501	4,420,470	0.0
Clean Harbors, Inc.	6.38%	02/01/2031	4,620	4,719,367	0.0
Crown Americas LLC	5.25%	04/01/2030	2,237	2,234,317	0.0
Eco Material Technologies, Inc.	7.88%	01/31/2027	19,423	19,631,504	0.1
EMRLD Borrower LP/Emerald Co-Issuer, Inc.	6.63%	12/15/2030	12,755	13,078,077	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
EnerSys	6.63%	01/15/2032	USD 11,317	\$ 11,861,398	0.1%
Esab Corp.	6.25%	04/15/2029	8,424	8,642,010	0.0
GFL Environmental, Inc.	3.50%	09/01/2028	1,000	945,403	0.0
GFL Environmental, Inc.	4.00%	08/01/2028	2,000	1,906,136	0.0
GFL Environmental, Inc.	6.75%	01/15/2031	5,344	5,587,052	0.0
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028	42,377	41,576,610	0.2
LSB Industries, Inc.	6.25%	10/15/2028	18,127	17,765,225	0.1
MIWD Holdco II LLC/MIWD Finance Corp.	5.50%	02/01/2030	15,439	14,687,906	0.1
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027	6,000	5,767,812	0.0
Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp.	7.25%	01/15/2031	5,710	6,039,171	0.0
Trinity Industries, Inc.	7.75%	07/15/2028	11,514	12,063,402	0.1
Triumph Group, Inc.	9.00%	03/15/2028	14,363	15,200,988	0.1
				<u>265,331,817</u>	<u>1.1</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
AMC Networks, Inc.	10.25%	01/15/2029	23,388	23,505,326	0.1
Banjay Entertainment SAS	8.13%	05/01/2029	14,465	14,995,838	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.25%	02/01/2031	17,363	15,072,676	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	08/15/2030	10,354	9,235,345	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	06/01/2033	63,959	53,407,762	0.2
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.75%	02/01/2032	10,382	9,047,929	0.0
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027	35,171	34,363,938	0.1
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	9.00%	09/15/2028	2,000	2,126,714	0.0
CSC Holdings LLC	11.25%	05/15/2028	13,685	12,154,808	0.1
CSC Holdings LLC	11.75%	01/31/2029	16,200	14,292,858	0.1
DISH DBS Corp.	5.25%	12/01/2026	24,639	21,071,530	0.1
DISH DBS Corp.	5.75%	12/01/2028	28,439	21,812,278	0.1
LCPR Senior Secured Financing DAC	5.13%	07/15/2029	32,037	25,904,750	0.1
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027	45,245	41,302,662	0.2
McGraw-Hill Education, Inc.	5.75%	08/01/2028	31,609	30,986,099	0.1
Neptune Bidco US, Inc.	9.29%	04/15/2029	44,194	44,131,651	0.2
Paramount Global	6.38%	03/30/2062	24,066	21,923,146	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030	3,945	2,357,456	0.0
Sirius XM Radio, Inc.	5.50%	07/01/2029	23,804	23,174,589	0.1
Summer BC Bidco B LLC	5.50%	10/31/2026	700	686,222	0.0
TEGNA, Inc.	4.63%	03/15/2028	16,589	15,589,328	0.1
Telenet Finance Luxembourg Notes SARL	5.50%	03/01/2028	3,000	2,905,270	0.0
Univision Communications, Inc.	6.63%	06/01/2027	27,939	27,656,184	0.1
Univision Communications, Inc.	8.00%	08/15/2028	10,291	10,405,478	0.0
Univision Communications, Inc.	8.50%	07/31/2031	25,104	25,046,567	0.1
Virgin Media Finance PLC	5.00%	07/15/2030	3,000	2,600,885	0.0
VZ Secured Financing BV	5.00%	01/15/2032	6,585	5,971,550	0.0
Ziggo Bond Co. BV	5.13%	02/28/2030	794	716,160	0.0
Ziggo BV	4.88%	01/15/2030	33,723	31,366,121	0.1
				<u>543,811,120</u>	<u>2.2</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Altice Financing SA	5.00%	01/15/2028	13,647	10,950,642	0.0
Altice Financing SA	5.75%	08/15/2029	21,913	16,888,597	0.1
Altice France SA	5.13%	07/15/2029	6,590	4,612,636	0.0
Altice France SA	5.50%	01/15/2028	2,919	2,081,147	0.0
Altice France SA	5.50%	10/15/2029	10,431	7,353,855	0.0
Nexstar Media, Inc.	5.63%	07/15/2027	12,925	12,630,733	0.1
Optics Bidco SpA	7.20%	07/18/2036	11,028	11,546,012	0.0
Optics Bidco SpA	7.72%	06/04/2038	6,026	6,521,170	0.0
Telecom Italia Capital SA	7.20%	07/18/2036	3,222	3,311,949	0.0
Telecom Italia Capital SA	7.72%	06/04/2038	2,502	2,654,852	0.0
Vmed O2 UK Financing I PLC	4.75%	07/15/2031	9,559	8,391,176	0.0
				<u>86,942,769</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.50%	04/01/2027	4,888	4,915,477	0.0
Aston Martin Capital Holdings Ltd.	10.00%	03/31/2029	34,719	35,340,637	0.1
Dana, Inc.	4.25%	09/01/2030	11,091	10,010,123	0.0
Dana, Inc.	4.50%	02/15/2032	8,098	7,180,971	0.0
Dana, Inc.	5.38%	11/15/2027	12,089	11,977,351	0.1
Garrett Motion Holdings, Inc./Garrett LX I SARL	7.75%	05/31/2032	33,145	34,349,725	0.1
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	5.00%	07/15/2029	2,698	2,506,798	0.0
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	5.25%	07/15/2031	10,523	9,560,636	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(e)	6.00%	05/15/2027	24,232	23,913,930	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(e)	6.38%	05/15/2029	13,427	13,213,543	0.1
Tenneco, Inc.	8.00%	11/17/2028	25,891	24,167,019	0.1
ZF North America Capital, Inc.	4.75%	04/29/2025	9,140	9,056,953	0.0
ZF North America Capital, Inc.	6.75%	04/23/2030	16,523	16,969,970	0.1
ZF North America Capital, Inc.	6.88%	04/14/2028	10,273	10,621,407	0.0
ZF North America Capital, Inc.	6.88%	04/23/2032	26,083	27,125,944	0.1
ZF North America Capital, Inc.	7.13%	04/14/2030	20,977	21,982,777	0.1
				<u>262,893,261</u>	<u>0.9</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Boyne USA, Inc.	4.75%	05/15/2029	USD 850	\$ 815,406	0.0%
Carnival Corp.	5.75%	03/01/2027	58,296	58,480,876	0.2
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./Magnum Management Corp./Millennium Op	5.25%	07/15/2029	9,350	9,212,250	0.0
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./Magnum Management Corp./Millennium Op	5.38%	04/15/2027	2,000	1,990,790	0.0
Merlin Entertainments Group US Holdings, Inc.	7.38%	02/15/2031	26,210	26,115,234	0.1
NCL Corp., Ltd.	5.88%	02/15/2027	2,000	2,002,628	0.0
NCL Corp., Ltd.	8.13%	01/15/2029	15,422	16,499,655	0.1
NCL Corp., Ltd.	8.38%	02/01/2028	27,665	29,135,417	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.38%	07/15/2027	18,007	18,045,312	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	08/31/2026	15,060	15,103,376	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	04/01/2028	15,887	15,998,166	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	6.25%	03/15/2032	17,039	17,575,217	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	7.25%	01/15/2030	6,586	6,966,044	0.0
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	5.25%	08/15/2029	23,359	22,555,880	0.1
				<u>240,496,251</u>	<u>1.0</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	4.88%	02/15/2030	15,093	14,071,510	0.1
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	6.25%	09/15/2027	49,014	48,899,227	0.2
Builders FirstSource, Inc.	4.25%	02/01/2032	2,800	2,558,992	0.0
Builders FirstSource, Inc.	5.00%	03/01/2030	6,000	5,825,332	0.0
Builders FirstSource, Inc.	6.38%	06/15/2032	5,000	5,155,205	0.0
Builders FirstSource, Inc.	6.38%	03/01/2034	27,881	28,628,839	0.1
Churchill Downs, Inc.	4.75%	01/15/2028	10,567	10,308,004	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	3.63%	02/15/2032	2,850	2,556,592	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.88%	04/01/2029	16,804	17,114,590	0.1
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	6.13%	04/01/2032	9,685	9,928,486	0.0
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower Esc	4.88%	07/01/2031	7,742	6,931,870	0.0
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower Esc	5.00%	06/01/2029	42,055	39,746,263	0.2
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower Esc	6.63%	01/15/2032	25,918	26,221,430	0.1
Installed Building Products, Inc.	5.75%	02/01/2028	5,196	5,149,734	0.0
KB Home	4.80%	11/15/2029	2,965	2,894,300	0.0
KB Home	6.88%	06/15/2027	4,102	4,262,648	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc.	4.50%	06/15/2029	19,780	18,406,969	0.1
Marriott Ownership Resorts, Inc.	4.75%	01/15/2028	850	811,961	0.0
Masterbrand, Inc.	7.00%	07/15/2032	8,925	9,203,624	0.0
Mattamy Group Corp.	4.63%	03/01/2030	22,478	21,260,722	0.1
Mattamy Group Corp.	5.25%	12/15/2027	2,850	2,813,212	0.0
MGM Resorts International	4.75%	10/15/2028	7,456	7,262,108	0.0
MGM Resorts International	5.50%	04/15/2027	4,532	4,532,563	0.0
Miter Brands Acquisition Holdco, Inc./ MIWD Borrower LLC	6.75%	04/01/2032	11,180	11,489,138	0.0
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	02/15/2028	19,163	18,703,701	0.1
Standard Building Solutions, Inc.	6.50%	08/15/2032	9,248	9,528,634	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.75%	01/15/2028	10,809	10,900,230	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.88%	06/15/2027	17,629	17,857,250	0.1
Thor Industries, Inc.	4.00%	10/15/2029	8,651	7,903,250	0.0
Travel & Leisure Co.	4.50%	12/01/2029	37,441	34,871,467	0.1
Travel & Leisure Co.	6.00%	04/01/2027	850	853,603	0.0
Travel & Leisure Co.	6.63%	07/31/2026	26,289	26,755,381	0.1
Wyndham Hotels & Resorts, Inc.	4.38%	08/15/2028	850	814,543	0.0
				<u>434,221,378</u>	<u>1.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	4.00%	10/15/2030	15,978	14,636,823	0.1
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	6.13%	06/15/2029	77,919	79,661,209	0.3
				<u>94,298,032</u>	<u>0.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Arko Corp.	5.13%	11/15/2029	11,996	10,668,277	0.0
Asbury Automotive Group, Inc.	4.50%	03/01/2028	850	821,013	0.0
Asbury Automotive Group, Inc.	4.63%	11/15/2029	8,367	7,979,541	0.0
Asbury Automotive Group, Inc.	5.00%	02/15/2032	21,593	20,332,544	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.63%	10/01/2030	424	429,455	0.0
Bath & Body Works, Inc.	6.75%	07/01/2036	30,670	31,432,819	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.95%	03/01/2033	329	328,961	0.0
Bath & Body Works, Inc.	7.60%	07/15/2037	716	709,774	0.0
Beacon Roofing Supply, Inc.	6.50%	08/01/2030	7,997	8,212,605	0.0
Cougar JV Subsidiary LLC	8.00%	05/15/2032	20,035	21,138,748	0.1
FirstCash, Inc.	4.63%	09/01/2028	9,231	8,839,062	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
FirstCash, Inc.	5.63%	01/01/2030	USD 21,733	\$ 21,414,773	0.1%
FirstCash, Inc.	6.88%	03/01/2032	19,962	20,521,946	0.1
Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd.	8.38%	01/15/2029	23,537	23,203,030	0.1
Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd.	8.75%	01/15/2032	18,671	17,864,853	0.1
Group 1 Automotive, Inc.	4.00%	08/15/2028	7,248	6,858,471	0.0
Group 1 Automotive, Inc.	6.38%	01/15/2030	6,293	6,401,382	0.0
Kontoor Brands, Inc.	4.13%	11/15/2029	850	801,240	0.0
LCM Investments Holdings II LLC.	8.25%	08/01/2031	16,251	17,275,588	0.1
Levi Strauss & Co.	3.50%	03/01/2031	23,739	21,464,163	0.1
Murphy Oil USA, Inc.	3.75%	02/15/2031	2,611	2,362,237	0.0
Murphy Oil USA, Inc.	4.75%	09/15/2029	12,302	11,943,737	0.1
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.	4.75%	02/15/2028	36,696	35,098,133	0.1
Sonic Automotive, Inc.	4.63%	11/15/2029	33,819	31,605,266	0.1
Sonic Automotive, Inc.	4.88%	11/15/2031	15,691	14,377,733	0.1
				<u>342,085,351</u>	<u>1.3</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
AdaptHealth LLC.	5.13%	03/01/2030	6,500	5,941,384	0.0
AdaptHealth LLC.	6.13%	08/01/2028	6,613	6,557,148	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC.	3.50%	03/15/2029	1,000	926,596	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC.	4.88%	02/15/2030	15,673	15,377,110	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC.	6.50%	02/15/2028	19,604	19,853,547	0.1
Amer Sports Co.	6.75%	02/16/2031	20,688	21,023,695	0.1
Bausch & Lomb Corp.	8.38%	10/01/2028	60,163	63,358,301	0.2
Cheplapharm Arzneimittel GmbH.	5.50%	01/15/2028	2,250	2,167,765	0.0
DaVita, Inc.	3.75%	02/15/2031	40,677	36,221,870	0.1
DaVita, Inc.	4.63%	06/01/2030	56,571	53,241,031	0.2
Elanco Animal Health, Inc.	6.65%	08/28/2028	21,340	22,164,897	0.1
Embecka Corp.	5.00%	02/15/2030	11,450	10,329,911	0.0
Emergent BioSolutions, Inc.	3.88%	08/15/2028	1,537	1,137,697	0.0
Endo Finance Holdings, Inc.	8.50%	04/15/2031	14,264	15,150,449	0.1
Fortrea Holdings, Inc.	7.50%	07/01/2030	21,140	21,585,476	0.1
IQVIA, Inc.	6.50%	05/15/2030	5,829	6,051,044	0.0
Medline Borrower LP.	3.88%	04/01/2029	69,912	66,117,882	0.3
Medline Borrower LP/Medline Co-Issuer, Inc.	6.25%	04/01/2029	6,402	6,602,729	0.0
ModivCare Escrow Issuer, Inc.	5.00%	10/01/2029	4,163	2,975,152	0.0
MPH Acquisition Holdings LLC.	5.50%	09/01/2028	34,619	25,256,943	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC.	5.75%	11/01/2028	16,132	7,399,505	0.0
Neogen Food Safety Corp.	8.63%	07/20/2030	11,791	12,845,470	0.1
Newell Brands, Inc.	6.38%	09/15/2027	4,430	4,461,809	0.0
Newell Brands, Inc.	6.63%	09/15/2029	16,159	16,162,229	0.1
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV.	4.13%	04/30/2028	18,538	17,714,505	0.1
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV.	5.13%	04/30/2031	46,269	43,290,115	0.2
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV.	6.75%	05/15/2034	25,540	26,525,905	0.1
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV.	7.88%	05/15/2034	2,000	2,110,753	0.0
Owens & Minor, Inc.	4.50%	03/31/2029	2,622	2,389,164	0.0
Owens & Minor, Inc.	6.63%	04/01/2030	9,602	9,295,188	0.0
Performance Food Group, Inc.	4.25%	08/01/2029	23,122	21,830,533	0.1
Perrigo Finance Unlimited Co.	4.90%	06/15/2030	3,000	2,900,300	0.0
Post Holdings, Inc.	4.50%	09/15/2031	8,368	7,783,656	0.0
Post Holdings, Inc.	4.63%	04/15/2030	5,000	4,753,161	0.0
Post Holdings, Inc.	5.50%	12/15/2029	6,547	6,430,802	0.0
Post Holdings, Inc.	5.63%	01/15/2028	7,135	7,114,351	0.0
Post Holdings, Inc.	6.25%	02/15/2032	10,198	10,466,026	0.0
Post Holdings, Inc.	6.38%	03/01/2033	24,823	25,010,470	0.1
Primo Water Holdings, Inc.	4.38%	04/30/2029	6,850	6,490,887	0.0
Sotera Health Holdings LLC.	7.38%	06/01/2031	26,020	27,228,072	0.1
Spectrum Brands, Inc.	3.88%	03/15/2031	257	229,162	0.0
US Foods, Inc.	4.75%	02/15/2029	1,000	975,013	0.0
				<u>665,447,703</u>	<u>2.4</u>
ENERGIE					
Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp.	5.38%	06/15/2029	2,000	1,976,718	0.0
Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp.	5.75%	01/15/2028	1,000	1,001,336	0.0
Berry Petroleum Co. LLC.	7.00%	02/15/2026	3,175	3,144,079	0.0
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	7.00%	07/15/2029	5,594	5,820,459	0.0
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	7.25%	07/15/2032	4,955	5,206,379	0.0
Buckeye Partners LP.	3.95%	12/01/2026	13,161	12,792,528	0.1
Buckeye Partners LP.	4.13%	03/01/2025	3,464	3,436,921	0.0
Buckeye Partners LP.	4.50%	03/01/2028	1,000	961,989	0.0
Buckeye Partners LP.	6.88%	07/01/2029	18,248	18,697,601	0.1
CITGO Petroleum Corp.	6.38%	06/15/2026	13,237	13,306,178	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
CITGO Petroleum Corp.	7.00%	06/15/2025	USD 45,862	\$ 45,934,394	0.2%
CITGO Petroleum Corp.	8.38%	01/15/2029	19,204	19,949,995	0.1
Civitas Resources, Inc.	5.00%	10/15/2026	5,580	5,513,462	0.0
Civitas Resources, Inc.	8.38%	07/01/2028	25,184	26,599,896	0.1
Civitas Resources, Inc.	8.63%	11/01/2030	9,764	10,633,684	0.0
Civitas Resources, Inc.	8.75%	07/01/2031	26,590	28,732,549	0.1
CNX Resources Corp.	6.00%	01/15/2029	19,876	19,959,306	0.1
CNX Resources Corp.	7.25%	03/01/2032	17,041	17,874,163	0.1
CNX Resources Corp.	7.38%	01/15/2031	1,000	1,045,291	0.0
CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC	5.50%	06/15/2031	5,062	4,964,737	0.0
Crescent Energy Finance LLC.	7.38%	01/15/2033	10,960	11,253,354	0.0
Crescent Energy Finance LLC.	7.63%	04/01/2032	9,817	10,127,135	0.0
Crescent Energy Finance LLC.	9.25%	02/15/2028	5,531	5,853,024	0.0
Encino Acquisition Partners Holdings LLC	8.50%	05/01/2028	12,292	12,655,794	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	7.75%	02/01/2028	34,229	34,829,045	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	8.00%	01/15/2027	17,227	17,666,121	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	7.00%	08/01/2027	7,835	7,907,908	0.0
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	8.25%	01/15/2032	10,805	11,243,907	0.0
Hess Midstream Operations LP.	4.25%	02/15/2030	3,008	2,844,471	0.0
Hess Midstream Operations LP.	5.13%	06/15/2028	1,000	988,649	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	5.75%	02/01/2029	5,408	5,373,637	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	6.00%	02/01/2031	7,941	7,903,632	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	6.25%	04/15/2032	850	848,764	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	6.88%	05/15/2034	12,643	12,804,929	0.1
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	8.38%	11/01/2033	1,400	1,853,059	0.0
Howard Midstream Energy Partners LLC.	7.38%	07/15/2032	15,641	16,183,691	0.1
ITT Holdings LLC.	6.50%	08/01/2029	36,137	34,148,816	0.1
Kodiak Gas Services LLC.	7.25%	02/15/2029	850	880,817	0.0
Murphy Oil Corp.	5.88%	12/01/2042	850	774,708	0.0
Nabors Industries, Inc.	7.38%	05/15/2027	17,675	17,866,956	0.1
Nabors Industries, Inc.	9.13%	01/31/2030	8,593	9,221,164	0.0
New Fortress Energy, Inc.	6.50%	09/30/2026	54,910	47,396,826	0.2
New Fortress Energy, Inc.	6.75%	09/15/2025	15,932	15,538,534	0.1
New Fortress Energy, Inc.	8.75%	03/15/2029	25,899	21,698,977	0.1
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp.	8.13%	02/15/2029	27,704	28,344,288	0.1
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp.	8.38%	02/15/2032	26,880	27,689,082	0.1
NuStar Logistics LP.	5.63%	04/28/2027	850	852,455	0.0
NuStar Logistics LP.	6.38%	10/01/2030	4,368	4,567,941	0.0
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.	6.00%	02/15/2028	5,179	5,123,772	0.0
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.	7.88%	09/15/2030	29,416	30,628,496	0.1
Permian Resources Operating LLC.	6.25%	02/01/2033	16,534	16,953,391	0.1
Southwestern Energy Co.	5.38%	02/01/2029	3,267	3,225,694	0.0
Sunoco LP.	7.00%	05/01/2029	12,552	13,082,132	0.1
Sunoco LP.	7.25%	05/01/2032	13,462	14,245,859	0.1
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	4.50%	05/15/2029	10,315	9,909,286	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	4.50%	04/30/2030	4,913	4,676,555	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	7.00%	09/15/2028	1,000	1,041,121	0.0
Venture Global Calcasieu Pass LLC.	6.25%	01/15/2030	18,061	18,791,034	0.1
Venture Global LNG, Inc.	7.00%	01/15/2030	9,833	10,064,584	0.0
Venture Global LNG, Inc.	9.88%	02/01/2032	12,438	13,842,822	0.1
				<u>758,134,095</u>	<u>2.9</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
American Builders & Contractors Supply Co., Inc.	4.00%	01/15/2028	3,925	3,774,551	0.0
Gates Corp./DE.	6.88%	07/01/2029	3,827	3,929,924	0.0
Resideo Funding, Inc.	6.50%	07/15/2032	18,283	18,619,471	0.1
Ritchie Bros Holdings, Inc.	7.75%	03/15/2031	10,375	11,038,180	0.0
Velocity Vehicle Group LLC.	8.00%	06/01/2029	13,945	14,497,318	0.1
				<u>51,859,444</u>	<u>0.2</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
ADT Security Corp. (The).	4.13%	08/01/2029	10,380	9,849,745	0.0
ADT Security Corp. (The).	4.88%	07/15/2032	1,314	1,251,028	0.0
Allied Universal Holdco LLC.	7.88%	02/15/2031	15,205	15,433,695	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL.	4.63%	06/01/2028	49,556	45,972,716	0.2
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL.	4.63%	06/01/2028	20,779	19,254,655	0.1
APX Group, Inc.	5.75%	07/15/2029	3,000	2,976,227	0.0
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027	43,029	43,071,489	0.2
Aramark Services, Inc.	5.00%	02/01/2028	5,261	5,156,638	0.0
Block, Inc.	6.50%	05/15/2032	38,384	39,838,280	0.2
Cars.com, Inc.	6.38%	11/01/2028	14,484	14,416,546	0.1
Garda World Security Corp.	4.63%	02/15/2027	13,850	13,504,092	0.1
Garda World Security Corp.	7.75%	02/15/2028	31,801	33,235,695	0.1
Millennium Escrow Corp.	6.63%	08/01/2026	24,610	14,713,398	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettövermögen %
Prime Security Services Borrower LLC/ Prime Finance, Inc.	3.38%	08/31/2027	USD 1,000	\$ 947,519	0.0%
Prime Security Services Borrower LLC/ Prime Finance, Inc.	5.75%	04/15/2026	12,000	12,041,816	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/ Prime Finance, Inc.	6.25%	01/15/2028	51,241	51,063,107	0.2
WASH Multifamily Acquisition, Inc.	5.75%	04/15/2026	7,706	<u>7,663,656</u>	<u>0.0</u>
				<u>330,390,302</u>	<u>1.5</u>
TECHNOLOGIE					
Amentum Escrow Corp.	7.25%	08/01/2032	5,765	6,023,759	0.0
Entegris, Inc.	5.95%	06/15/2030	12,650	12,814,286	0.1
Gen Digital, Inc.	5.00%	04/15/2025	1,000	995,675	0.0
Gen Digital, Inc.	6.75%	09/30/2027	26,207	26,877,318	0.1
Gen Digital, Inc.	7.13%	09/30/2030	22,433	23,450,763	0.1
GoTo Group, Inc.	5.50%	05/01/2028	128	99,415	0.0
GoTo Group, Inc.	5.50%	05/01/2028	177	65,562	0.0
Playtika Holding Corp.	4.25%	03/15/2029	7,358	6,627,118	0.0
Science Applications International Corp.	4.88%	04/01/2028	850	825,821	0.0
Seagate HDD Cayman	4.09%	06/01/2029	7,300	6,948,642	0.0
Seagate HDD Cayman	5.75%	12/01/2034	3,000	3,004,615	0.0
Seagate HDD Cayman	8.25%	12/15/2029	21,529	23,353,913	0.1
Seagate HDD Cayman	8.50%	07/15/2031	32,166	34,999,565	0.1
Sensata Technologies BV.	5.88%	09/01/2030	10,263	10,244,644	0.0
Western Digital Corp.	4.75%	02/15/2026	5,263	<u>5,213,532</u>	<u>0.0</u>
				<u>161,544,628</u>	<u>0.5</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Allegiant Travel Co.	7.25%	08/15/2027	10,577	10,059,443	0.0
American Airlines, Inc.	7.25%	02/15/2028	2,000	2,012,669	0.0
American Airlines, Inc./AAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.50%	04/20/2026	6,092	6,058,545	0.0
American Airlines, Inc./AAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.75%	04/20/2029	36,464	35,775,501	0.1
HawaiianMiles Loyalty Ltd.	11.00%	04/15/2029	6,023	6,126,919	0.0
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.	8.00%	09/20/2025	26,356	16,421,438	0.1
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.	8.00%	09/20/2025	4,213	2,632,709	0.0
United Airlines, Inc.	4.38%	04/15/2026	14,049	<u>13,722,813</u>	<u>0.1</u>
				<u>92,810,037</u>	<u>0.3</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Albion Financing 1 SARL/Aggreko Holdings, Inc.	6.13%	10/15/2026	20,357	20,222,068	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	4.75%	04/01/2028	17,737	16,469,262	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.38%	03/01/2029	25,378	23,319,576	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.75%	07/15/2027	5,850	5,686,918	0.0
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.75%	07/15/2027	2,456	2,393,805	0.0
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	8.00%	02/15/2031	5,030	5,002,656	0.0
Hertz Corp. (The)	12.63%	07/15/2029	31,301	33,400,981	0.1
PROG Holdings, Inc.	6.00%	11/15/2029	16,432	<u>16,038,799</u>	<u>0.1</u>
				<u>122,534,065</u>	<u>0.5</u>
				<u>4,785,585,181</u>	<u>17.9</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Bread Financial Holdings, Inc.	7.00%	01/15/2026	2,602	2,603,643	0.0
Bread Financial Holdings, Inc.	9.75%	03/15/2029	36,787	39,716,003	0.2
Synchrony Financial	7.25%	02/02/2033	8,250	<u>8,537,364</u>	<u>0.0</u>
				<u>50,857,010</u>	<u>0.2</u>
MAKLER					
AG TTMT Escrow Issuer LLC	8.63%	09/30/2027	28,521	29,482,011	0.1
Aretec Group, Inc.	10.00%	08/15/2030	18,995	20,510,938	0.1
VFH Parent LLC/Valor Co-Issuer, Inc.	7.50%	06/15/2031	13,772	<u>14,315,613</u>	<u>0.1</u>
				<u>64,308,562</u>	<u>0.3</u>
FINANZEN					
Castlelake Aviation Finance DAC	5.00%	04/15/2027	11,374	11,104,277	0.0
GGAM Finance Ltd.	7.75%	05/15/2026	15,162	15,551,765	0.1
GGAM Finance Ltd.	8.00%	02/15/2027	11,361	11,848,790	0.1
GGAM Finance Ltd.	8.00%	06/15/2028	32,741	35,010,516	0.1
goeasy Ltd.	7.63%	07/01/2029	33,686	34,722,740	0.1
Jefferies Finance LLC/JFIN Co-Issuer Corp.	5.00%	08/15/2028	35,186	33,429,249	0.1
Navient Corp.	4.88%	03/15/2028	9,250	8,813,194	0.0
Navient Corp.	5.00%	03/15/2027	6,824	6,685,790	0.0
Navient Corp.	5.50%	03/15/2029	3,039	2,890,380	0.0
SLM Corp.	3.13%	11/02/2026	3,939	<u>3,770,854</u>	<u>0.0</u>
				<u>163,827,555</u>	<u>0.5</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
VERSICHERUNGEN					
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.....	4.25%	02/15/2029	USD 2,195	\$ 2,053,600	0.0%
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.....	7.50%	11/06/2030	21,620	22,225,311	0.1
AmWINS Group, Inc.	6.38%	02/15/2029	9,432	9,667,520	0.0
Ardonagh Finco Ltd.	7.75%	02/15/2031	24,167	24,948,280	0.1
Howden UK Refinance PLC/Howden UK Refinance 2 PLC/ Howden US Refinance LLC	7.25%	02/15/2031	23,618	24,348,257	0.1
HUB International Ltd.	7.25%	06/15/2030	43,226	45,210,684	0.2
Panther Escrow Issuer LLC.....	7.13%	06/01/2031	29,587	30,821,930	0.1
				<u>159,275,582</u>	<u>0.6</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
Encore Capital Group, Inc.	8.50%	05/15/2030	30,407	31,834,170	0.1
Encore Capital Group, Inc.	9.25%	04/01/2029	7,056	7,521,883	0.0
				<u>39,356,053</u>	<u>0.1</u>
REITs					
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	4.50%	04/01/2027	12,883	12,445,646	0.1
Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2029	10,460	10,154,778	0.0
Iron Mountain, Inc.	5.00%	07/15/2028	10,020	9,813,553	0.0
Iron Mountain, Inc.	5.25%	03/15/2028	12,339	12,200,484	0.1
Service Properties Trust.	8.38%	06/15/2029	1,400	1,383,788	0.0
Service Properties Trust.	8.63%	11/15/2031	2,000	2,134,903	0.0
				<u>48,133,152</u>	<u>0.2</u>
				<u>525,757,914</u>	<u>1.9</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
AES Andes SA.....	8.15%	06/10/2055	12,816	13,134,680	0.1
Lightning Power LLC	7.25%	08/15/2032	22,906	23,669,763	0.1
NRG Energy, Inc.....	3.38%	02/15/2029	1,000	918,553	0.0
NRG Energy, Inc.....	3.88%	02/15/2032	2,436	2,185,739	0.0
Terraform Global Operating LP.....	6.13%	03/01/2026	7,871	7,872,322	0.0
Vistra Operations Co. LLC	5.63%	02/15/2027	18,523	18,497,806	0.1
Vistra Operations Co. LLC	7.75%	10/15/2031	2,000	2,130,861	0.0
				<u>68,409,724</u>	<u>0.3</u>
				<u>5,379,752,819</u>	<u>20.1</u>
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSZAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	3.50%	09/01/2049	3,348	3,123,655	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	4.00%	08/01/2049	831	798,888	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	5.00%	11/01/2049	3,142	3,191,689	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2022	4.50%	09/01/2052	137,208	133,652,236	0.5
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	4.50%	10/01/2053	139,646	135,841,669	0.5
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	5.00%	02/01/2053	82,915	82,382,750	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	5.00%	04/01/2053	50,509	50,140,792	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	5.00%	06/01/2053	74,590	74,045,557	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	5.00%	10/01/2053	21,523	21,359,651	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	5.50%	06/01/2053	266,358	268,201,423	1.0
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	5.50%	07/01/2053	57,884	58,284,602	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	5.50%	08/01/2053	60,048	60,463,525	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	6.00%	10/01/2053	176,181	179,444,382	0.7
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	6.00%	11/01/2053	162,210	165,164,095	0.6
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2023	6.50%	11/01/2053	88,786	91,474,320	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2024	5.00%	06/01/2054	18,226	18,087,402	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2024	6.00%	04/01/2054	31,400	31,971,909	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2019	3.50%	10/01/2049	2,020	1,890,440	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	3.50%	10/01/2049	1,387	1,297,667	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	4.00%	09/01/2049	675	648,828	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	4.00%	09/01/2049	1,114	1,075,871	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	4.00%	09/01/2049	1,028	988,960	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	4.00%	10/01/2049	1,208	1,166,791	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	4.00%	10/01/2049	1,183	1,139,420	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	4.00%	10/01/2049	1,270	1,226,463	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	4.00%	10/01/2049	1,069	1,030,029	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2023	5.00%	06/01/2053	13,104	13,008,417	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2023	5.00%	07/01/2053	33,736	33,490,142	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2023	5.00%	08/01/2053	207,277	205,764,830	0.8
Federal National Mortgage Association, Series 2023	5.00%	12/01/2053	71,512	70,990,728	0.3
Federal National Mortgage Association, Series 2023	5.50%	04/01/2053	85,656	86,275,692	0.3
Federal National Mortgage Association, Series 2023	5.50%	05/01/2053	17,086	17,209,881	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2023	5.50%	06/01/2053	24,417	24,586,287	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2023	5.50%	07/01/2053	213,454	214,931,776	0.8
Federal National Mortgage Association, Series 2023	5.50%	08/01/2053	74,370	74,884,645	0.3
Federal National Mortgage Association, Series 2024	5.00%	05/01/2054	70,631	70,093,557	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Federal National Mortgage Association, Series 2024	5.00%	07/01/2024	USD 9,789	\$ 9,714,259	0.0%
Federal National Mortgage Association, Series 2024	5.00%	09/01/2024	12,530	12,434,690	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2024	5.50%	07/01/2024	20,652	20,788,115	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2024	5.50%	08/01/2024	9,632	9,695,223	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2024	5.50%	09/01/2024	20,500	20,635,491	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2024	6.00%	08/01/2024	24,869	25,321,807	0.1
Government National Mortgage Association, Series 2023	5.00%	05/20/2023	30,582	30,514,211	0.1
Government National Mortgage Association, Series 2023	5.00%	07/20/2023	96,411	96,257,599	0.4
Government National Mortgage Association, Series 2023	5.00%	09/20/2023	120,468	120,275,755	0.4
Government National Mortgage Association, Series 2023	5.50%	06/20/2023	55,631	56,009,728	0.2
Government National Mortgage Association, Series 2023	5.50%	07/20/2023	22,548	22,694,660	0.1
				<u>2,623,670,507</u>	<u>9.7</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Alpek SAB de CV	4.25%	09/18/2029	3,164	3,008,964	0.0
Braskem Idesa SAPI	6.99%	02/20/2032	37,202	29,006,027	0.1
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029	15,555	13,056,556	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/10/2028	40,037	37,324,493	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030	10,720	9,390,184	0.0
Cia de Minas Buenaventura SAA	5.50%	07/23/2026	12,050	11,778,875	0.1
CSN Inova Ventures	6.75%	01/28/2028	11,082	10,604,089	0.0
CSN Resources SA	4.63%	06/10/2031	42,008	33,068,278	0.1
Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	8.38%	07/23/2029	13,939	14,193,108	0.1
First Quantum Minerals Ltd.	8.63%	06/01/2031	27,741	27,749,669	0.1
First Quantum Minerals Ltd.	9.38%	03/01/2029	16,021	17,070,695	0.1
Freeport Indonesia PT	4.76%	04/14/2027	5,354	5,349,877	0.0
Indika Energy Tbk PT	8.75%	05/07/2029	26,637	27,161,416	0.1
Industrias Penoles SAB de CV	5.65%	09/12/2049	4,016	3,639,500	0.0
Inversiones CMPC SA	6.13%	02/26/2034	4,804	5,043,649	0.0
JSW Steel Ltd.	3.95%	04/05/2027	5,358	5,103,495	0.0
JSW Steel Ltd.	5.05%	04/05/2032	8,730	7,990,678	0.0
Nexa Resources SA	6.75%	04/09/2034	22,316	23,400,507	0.1
OCP SA	6.75%	05/02/2034	13,138	14,008,393	0.1
Periama Holdings LLC/DE	5.95%	04/19/2026	9,463	9,427,987	0.0
Sasol Financing USA LLC	5.50%	03/18/2031	15,950	13,956,250	0.1
Sasol Financing USA LLC	8.75%	05/03/2029	22,943	23,929,512	0.1
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	4.25%	05/07/2029	5,332	5,172,040	0.0
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	6.50%	11/07/2033	9,390	10,085,423	0.0
Stillwater Mining Co.	4.00%	11/16/2026	5,644	5,277,140	0.0
Stillwater Mining Co.	4.00%	11/16/2026	22,427	20,969,245	0.1
Stillwater Mining Co.	4.50%	11/16/2029	5,188	4,331,980	0.0
Suzano Austria GmbH	3.75%	01/15/2031	5,486	4,990,614	0.0
Suzano Austria GmbH	5.00%	01/15/2030	9,588	9,434,592	0.0
Suzano Austria GmbH	6.00%	01/15/2029	37,735	38,555,736	0.2
Suzano Austria GmbH, Series DM3N	3.13%	01/15/2032	4,108	3,497,962	0.0
UPL Corp., Ltd.	4.50%	03/08/2028	6,610	5,946,934	0.0
UPL Corp., Ltd.	4.63%	06/16/2030	19,271	16,410,413	0.1
Vale Overseas Ltd.	6.13%	06/12/2033	10,665	11,110,158	0.1
Volcan Cia Minera SAA	4.38%	02/11/2026	6,560	5,614,966	0.0
				<u>486,659,405</u>	<u>1.8</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Cemex SAB de CV	3.88%	07/11/2031	1,650	1,495,643	0.0
Cemex SAB de CV(b)	5.13%	06/08/2026	24,345	23,839,841	0.1
Cemex SAB de CV(b)	9.13%	03/14/2028	10,891	11,843,963	0.1
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	26,107	26,286,616	0.1
IHS Holding Ltd.	6.25%	11/29/2028	2,727	2,507,327	0.0
St. Marys Cement, Inc. Canada	5.75%	04/02/2034	5,887	5,943,142	0.0
Usiminas International SARL	5.88%	07/18/2026	11,294	11,113,974	0.1
				<u>83,030,506</u>	<u>0.4</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030	23,890	22,060,922	0.1
Globo Comunicacao e Participacoes SA	5.50%	01/14/2032	8,042	7,404,913	0.0
Prosus NV	3.06%	07/13/2031	36,327	31,161,755	0.1
Prosus NV	3.26%	01/19/2027	23,750	22,651,563	0.1
Telecomunicaciones Digitales SA	4.50%	01/30/2030	886	805,711	0.0
Weibo Corp.	3.38%	07/08/2030	14,650	13,136,655	0.1
				<u>97,221,519</u>	<u>0.4</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
C&W Senior Finance Ltd.	6.88%	09/15/2027	19,556	19,245,970	0.1
CT Trust	5.13%	02/03/2032	3,036	2,721,015	0.0
Millicom International Cellular SA	7.38%	04/02/2032	8,145	8,228,720	0.0
PT Tower Bersama Infrastructure Tbk	2.80%	05/02/2027	5,030	4,712,481	0.0
Sable International Finance Ltd.	5.75%	09/07/2027	24,916	24,549,984	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Xiaomi Best Time International Ltd.	3.38%	04/29/2030	USD 11,588	\$ 10,646,475	0.0%
				<u>70,104,645</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Ford Otomotiv Sanayi AS	7.13%	04/25/2029	13,978	14,361,417	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
GENM Capital Labuan Ltd.	3.88%	04/19/203	12,294	10,991,604	0.1
Gohl Capital Ltd.	4.25%	01/24/2027	20,443	19,983,033	0.1
				<u>30,974,637</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Falabella SA.	3.38%	01/15/2032	17,171	14,665,107	0.1
Falabella SA.	3.38%	01/15/2032	4,912	4,195,155	0.0
Falabella SA.	3.75%	10/30/2027	16,745	15,888,493	0.1
				<u>34,748,755</u>	<u>0.2</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
BRF GmbH	4.35%	09/29/2026	4,478	4,354,989	0.0
BRF SA	4.88%	01/24/2030	5,816	5,467,040	0.0
Cencosud SA	5.95%	05/28/2031	13,643	14,057,747	0.1
Central American Bottling Corp./CBC Bottling Holdco SL/ Beliv Holdco SL	5.25%	04/27/2029	5,267	5,077,717	0.0
MARB BondCo PLC	3.95%	01/29/2031	25,840	21,860,640	0.1
Natura &Co Luxembourg Holdings SARL	4.13%	05/03/2028	3,405	3,093,635	0.0
Natura &Co Luxembourg Holdings SARL	6.00%	04/19/2029	11,231	10,672,707	0.0
NBM US Holdings, Inc.	6.63%	08/06/2029	10,000	10,028,100	0.0
Rede D’or Finance SARL	4.50%	01/22/2030	512	480,000	0.0
Rede D’or Finance SARL	4.95%	01/17/2028	2,969	2,917,043	0.0
				<u>78,009,618</u>	<u>0.2</u>
ENERGIE					
Acu Petroleo Luxembourg SARL	7.50%	01/13/2032	10,335	10,222,056	0.0
Azure Power Solar Energy Pvt. Ltd.	5.65%	12/24/2024	12,494	12,452,270	0.1
Canacol Energy Ltd.	5.75%	11/24/2028	6,412	3,694,915	0.0
Canacol Energy Ltd.	5.75%	11/24/2028	11,489	6,620,536	0.0
Ecopetrol SA	4.63%	11/02/2031	11,890	10,055,373	0.0
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	18,715	18,649,498	0.1
Ecopetrol SA	8.63%	01/19/2029	33,666	36,033,056	0.1
Geopark Ltd.	5.50%	01/17/2027	8,246	7,777,050	0.0
Gran Tierra Energy, Inc.	9.50%	10/15/2029	13,051	12,683,941	0.1
Greenko Solar Mauritius Ltd.	5.55%	01/29/2025	7,409	7,375,067	0.0
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.	5.50%	04/06/2025	2,169	2,156,122	0.0
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.	5.50%	04/06/2025	26,007	25,852,583	0.1
HPCL-Mittal Energy Ltd.	5.45%	10/22/2026	2,624	2,585,873	0.0
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	8.55%	09/18/2033	11,612	12,990,925	0.1
KazMunayGas National Co. JSC.	4.75%	04/19/2027	15,597	15,413,579	0.1
KazMunayGas National Co. JSC.	5.38%	04/24/2030	27,672	27,360,690	0.1
Medco Maple Tree Pte Ltd.	8.96%	04/27/2029	7,463	7,896,787	0.0
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034	9,610	9,331,471	0.0
Oleoducto Central SA	4.00%	07/14/2027	8,487	8,102,433	0.0
Raizen Fuels Finance SA.	6.45%	03/05/2034	23,173	24,413,772	0.1
SierraCol Energy Andina LLC.	6.00%	06/15/2028	8,865	8,050,572	0.0
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	3.25%	08/15/2030	20,132	17,200,378	0.1
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	4.00%	08/15/2026	25,480	24,715,600	0.1
Transportadora de Gas del Peru SA.	4.25%	04/30/2028	4,800	4,693,488	0.0
Transportadora de Gas Internacional SA ESP.	5.55%	11/01/2028	9,600	9,549,000	0.0
				<u>325,877,035</u>	<u>1.1</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
KOC Holding AS	6.50%	03/11/2025	8,568	8,580,595	0.0
DIENSTLEISTUNGEN					
Bidvest Group UK PLC (The)	3.63%	09/23/2026	9,421	8,978,213	0.0
TECHNOLOGIE					
Baidu, Inc.	3.43%	04/07/2030	345	325,007	0.0
Lenovo Group Ltd.	3.42%	11/02/2030	12,000	10,961,250	0.0
Lenovo Group Ltd.	6.54%	07/27/2032	4,000	4,322,000	0.0
Xiaomi Best Time International Ltd.	2.88%	07/14/2031	12,258	10,618,493	0.0
				<u>26,226,750</u>	<u>0.0</u>
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN					
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	18,555	17,279,765	0.1
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	5.88%	07/05/2034	16,422	16,545,311	0.1
				<u>33,825,076</u>	<u>0.2</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	4.00%	07/30/2027	28,925	27,570,442	0.1
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	4.20%	08/04/2027	5,275	5,044,483	0.0
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	4.38%	07/03/2029	10,323	9,652,005	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettöver- mögen %
TAV Havalimanlari Holding AS	8.50%	12/07/2028	USD 5,304	\$ 5,526,105	0.0%
				47,793,035	0.1
				1,346,391,206	4.9
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Absa Group Ltd.(b)	6.38%	05/27/2026	4,093	4,009,871	0.0
Banco de Credito del Peru SA	3.13%	07/01/2030	20,748	20,214,776	0.1
Banco de Credito del Peru SA	5.85%	01/11/2029	6,236	6,445,048	0.0
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	5.38%	04/17/2025	23,905	23,833,285	0.1
BBVA Bancomer SA/Texas	5.88%	09/13/2034	26,946	26,018,249	0.1
				80,521,229	0.3
MAKLER					
China Great Wall International Holdings III Ltd., Series E	3.88%	08/31/2027	20,600	19,589,312	0.1
FINANZEN					
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	4.75%	04/27/2027	2,150	2,081,200	0.0
Huarong Finance 2017 Co., Ltd., Series E	4.25%	11/07/2027	1,054	1,000,351	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd., Series E	4.63%	06/03/2026	18,250	17,885,000	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd., Series E	4.88%	11/22/2026	4,216	4,138,267	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd., Series E	5.50%	01/16/2025	39,399	39,308,382	0.2
REC Ltd.	5.63%	04/11/2028	3,793	3,873,601	0.0
				68,286,801	0.3
REITs					
Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030	45,680	42,082,700	0.2
Trust Fibra Uno	5.25%	01/30/2026	8,686	8,627,543	0.0
				50,710,243	0.2
				219,107,585	0.9
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Adani Electricity Mumbai Ltd.	3.87%	07/22/2031	1,025	884,063	0.0
Adani Electricity Mumbai Ltd.	3.95%	02/12/2030	9,458	8,488,555	0.0
Adani Green Energy Ltd.	4.38%	09/08/2024	8,473	8,469,611	0.0
Adani Transmission Step-One Ltd.	4.00%	08/03/2026	15,853	15,342,732	0.1
AES Andes SA	6.30%	03/15/2029	5,947	6,127,373	0.0
AES Panama Generation Holdings SRL	4.38%	05/31/2030	15,649	13,995,824	0.1
Buffalo Energy Mexico Holdings/Buffalo Energy Infrastructure/Buffalo Energy	7.88%	02/15/2039	15,090	16,179,800	0.1
Cometa Energia SA de CV	6.38%	04/24/2035	11,974	12,093,246	0.1
Consorcio Transmantaro SA	5.20%	04/11/2038	3,908	3,802,973	0.0
Continuum Energy Aura Pte Ltd.	9.50%	02/24/2027	9,631	9,998,230	0.0
Continuum Green Energy India Pvt./Co-Issuers	7.50%	06/26/2033	12,771	13,126,162	0.1
Diamond II Ltd.	7.95%	07/28/2026	16,425	16,625,353	0.1
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027	3,608	3,480,035	0.0
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.25%	07/18/2029	24,989	22,535,580	0.1
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.38%	02/15/2031	19,852	17,301,217	0.1
Engie Energia Chile SA	6.38%	04/17/2034	15,010	15,807,256	0.1
India Clean Energy Holdings	4.50%	04/18/2027	13,448	12,578,083	0.1
Infraestructura Energetica Nova SAPI de CV	3.75%	01/14/2028	4,898	4,663,680	0.0
Investment Energy Resources Ltd.	6.25%	04/26/2029	11,154	11,018,033	0.1
Kallpa Generacion SA	4.13%	08/16/2027	4,601	4,456,621	0.0
LLPL Capital Pte Ltd.	6.88%	02/04/2039	8,401	8,655,730	0.0
Minejesa Capital BV	4.63%	08/10/2030	57,215	55,841,816	0.2
Terraform Global Operating LP	6.13%	03/01/2026	7,314	7,315,229	0.0
				288,787,202	1.3
ERDGAS					
GNL Quintero SA	4.63%	07/31/2029	7,178	7,091,549	0.0
Grupo Energia Bogota SA ESP	7.85%	11/09/2033	10,000	11,330,157	0.1
				18,421,706	0.1
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE					
Aegea Finance SARL	6.75%	05/20/2029	6,096	6,119,469	0.0
Aegea Finance SARL	9.00%	01/20/2031	10,148	10,880,949	0.0
				17,000,418	0.0
				324,209,326	1.4
STAATSANLEIHEN					
ANGOLA					
Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029	17,946	16,476,671	0.1
Angolan Government International Bond	9.50%	11/12/2025	12,861	13,098,125	0.1
				29,574,796	0.2

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
BRASILIEN						
	Brazilian Government International Bond	6.00%	10/20/2033	USD 9,047	\$ 9,058,761	0.0%
	Brazilian Government International Bond	8.25%	01/20/2034	7,573	8,776,350	0.0
					<u>17,835,111</u>	<u>0.0</u>
KOLUMBIEN						
	Colombia Government International Bond	3.13%	04/15/2031	4,454	3,641,145	0.0
	Colombia Government International Bond	3.25%	04/22/2032	47,384	37,765,048	0.1
	Colombia Government International Bond	5.63%	02/26/2044	7,843	6,246,557	0.0
	Colombia Government International Bond	8.00%	11/14/2035	1,570	1,665,770	0.0
					<u>49,318,520</u>	<u>0.1</u>
ELFENBEINKÜSTE						
	Ivory Coast Government International Bond	5.75%	12/31/2032	26,134	24,637,377	0.1
	Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	35,155	32,133,867	0.1
	Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	39,769	39,491,412	0.2
	Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	8,458	8,398,963	0.0
					<u>104,661,619</u>	<u>0.4</u>
DOMINIKANISCHE REPUBLIK						
	Dominican Republic International Bond	4.50%	01/30/2030	54,271	51,406,034	0.2
	Dominican Republic International Bond	4.88%	09/23/2032	16,073	15,128,711	0.1
	Dominican Republic International Bond	5.50%	02/22/2029	6,306	6,313,883	0.0
	Dominican Republic International Bond	6.00%	07/19/2028	8,000	8,155,040	0.0
	Dominican Republic International Bond	6.88%	01/29/2026	4,828	4,909,473	0.0
	Dominican Republic International Bond	8.63%	04/20/2027	9,817	10,240,407	0.0
					<u>96,153,548</u>	<u>0.3</u>
ÄGYPTEN						
	Egypt Government International Bond	6.59%	02/21/2028	2,395	2,231,092	0.0
	Egypt Government International Bond	7.05%	01/15/2032	6,969	5,821,293	0.0
	Egypt Government International Bond	7.63%	05/29/2032	6,932	5,935,525	0.0
					<u>13,987,910</u>	<u>0.0</u>
EL SALVADOR						
	El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	8,851	8,292,281	0.0
	El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	804	557,019	0.0
					<u>8,849,300</u>	<u>0.0</u>
GUATEMALA						
	Guatemala Government Bond	6.05%	08/06/2031	12,145	12,382,313	0.1
KENIA						
	Republic of Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027	19,297	18,488,938	0.1
NIGERIA						
	Nigeria Government International Bond	6.13%	09/28/2028	7,834	7,050,600	0.0
	Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027	25,500	23,746,875	0.1
	Nigeria Government International Bond	7.14%	02/23/2030	1,599	1,446,595	0.0
	Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047	13,971	10,539,373	0.0
	Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	12,210	9,783,263	0.0
	Nigeria Government International Bond	7.88%	02/16/2032	3,948	3,513,720	0.0
					<u>56,080,426</u>	<u>0.1</u>
PANAMA						
	Panama Government International Bond	6.88%	01/31/2036	4,189	4,293,725	0.0
	Panama Government International Bond	7.50%	03/01/2031	1,510	1,615,700	0.0
					<u>5,909,425</u>	<u>0.0</u>
SENEGAL						
	Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	43,004	37,319,409	0.1
	Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	22,447	16,694,956	0.1
					<u>54,014,365</u>	<u>0.2</u>
SÜDAFRIKA						
	Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	31,945	25,715,725	0.1
	Republic of South Africa Government International Bond	6.30%	06/22/2048	14,391	12,466,204	0.1
					<u>38,181,929</u>	<u>0.2</u>
UKRAINE						
	Ukraine Government International Bond	7.25%	03/15/2035	8,080	2,448,240	0.0
					<u>507,886,440</u>	<u>1.7</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG						
	Senegal Government International Bond, Series 7Y	7.75%	06/10/2031	26,607	25,692,384	0.1
					<u>2,423,286,941</u>	<u>9.0</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN						
CLO – VARIABEL VERZINSLICH						
	AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class D(c)	8.46%	04/15/2034	6,750	6,756,109	0.0
	AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class D(c)	8.71%	04/15/2034	4,750	4,757,838	0.0
	AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class D(c)	8.39%	07/20/2034	6,000	6,002,676	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
AGL CLO 9 Ltd., Series 2020-9A, Class DR(c)	8.83%	04/20/2037	USD 4,250	\$ 4,278,144	0.0%
AIMCO CLO, Series 2018-AA, Class A(c)	6.57%	04/17/2031	6,736	6,736,928	0.0
Allegro CLO XI Ltd., Series 2019-2A, Class A1AR(c)	6.53%	01/19/2033	40,000	40,017,640	0.2
Apidos CLO XXIII, Series 2015-23A, Class ER(c)	11.76%	04/15/2033	2,248	2,252,045	0.0
Apidos CLO XXX, Series XXXA, Class A1AR(c)	6.28%	10/18/2031	44,000	44,000,000	0.2
Apidos CLO XXXII, Series 2019-32A, Class A1R(c)	6.38%	01/20/2033	39,985	39,984,640	0.2
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class D(c)	8.19%	04/20/2034	6,000	5,973,774	0.0
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2021-4A, Class D(c)	8.64%	10/20/2034	4,000	3,963,964	0.0
Bain Capital Credit CLO, Series 2019-1A, Class AR2(c)	6.35%	04/19/2034	6,135	6,134,853	0.0
Bain Capital Credit CLO, Series 2019-2A, Class AR2(c)	6.42%	10/17/2032	45,000	45,022,365	0.2
Ballyrock CLO 14 Ltd., Series 2020-14A, Class C1R(c)	8.30%	07/20/2037	8,330	8,278,296	0.0
Ballyrock CLO Ltd., Series 2018-1A, Class A1(c)	6.54%	04/20/2031	1,787	1,787,379	0.0
Benefit Street Partners CLO VIII Ltd., Series 2015-8A, Class A1AR(c)	6.64%	01/20/2031	4,938	4,939,994	0.0
Betony CLO 2 Ltd., Series 2018-1A, Class A1(c)	6.60%	04/30/2031	2,499	2,504,083	0.0
Betony CLO 2 Ltd., Series 2018-1X, Class A1(c)	6.60%	04/30/2031	14,859	14,889,144	0.1
Black Diamond CLO Ltd., Series 2016-1A, Class A2AR(c)	7.29%	04/26/2031	11,000	11,003,652	0.1
BlueMountain CLO Ltd., Series 2015-3A, Class A1R(c)	6.54%	04/20/2031	23,384	23,400,495	0.1
Carbone CLO Ltd., Series 2017-1A, Class A1(c)	6.68%	01/20/2031	20,046	20,068,183	0.1
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd., Series 2012-3A, Class A1A2(c)	6.74%	01/14/2032	9,417	9,422,793	0.0
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd., Series 2014-1A, Class A1R2(c)	6.52%	04/17/2031	11,832	11,879,307	0.1
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd., Series 2014-3RA, Class A1A(c)	6.58%	07/27/2031	4,288	4,298,624	0.0
Catamaran CLO Ltd., Series 2014-1A, Class A1AR(c)	6.64%	04/22/2030	3,550	3,552,589	0.0
CBAM Ltd., Series 2018-5A, Class A(c)	6.57%	04/17/2031	13,447	13,449,421	0.1
CBAM Ltd., Series 2018-7A, Class B1(c)	7.14%	07/20/2031	7,726	7,739,119	0.0
CIFC Funding Ltd., Series 2013-3RA, Class A1(c)	6.52%	04/24/2031	2,575	2,579,986	0.0
CIFC Funding Ltd., Series 2014-2RA, Class A1(c)	6.59%	04/24/2030	4,129	4,129,089	0.0
CIFC Funding Ltd., Series 2015-1A, Class ARR(c)	6.65%	01/22/2031	7,171	7,189,360	0.0
CIFC Funding Ltd., Series 2018-1A, Class A(c)	6.54%	04/18/2031	10,492	10,507,807	0.0
CIFC Funding Ltd., Series 2018-2A, Class A1(c)	6.58%	04/20/2031	1,556	1,557,005	0.0
CIFC Funding Ltd., Series 2018-3X, Class A(c)	6.64%	07/18/2031	8,340	8,345,094	0.0
CIFC Funding Ltd., Series 2018-4A, Class A1(c)	6.70%	10/17/2031	30,820	30,854,884	0.1
Clover CLO LLC, Series 2021-3A, Class D(c)	8.65%	01/25/2035	10,400	10,467,028	0.0
Dryden 30 Senior Loan Fund, Series 2013-30A, Class AR(c)	6.20%	11/15/2028	3,183	3,192,845	0.0
Dryden 41 Senior Loan Fund, Series 2015-41A, Class AR(c)	6.53%	04/15/2031	2,525	2,528,045	0.0
Dryden 53 CLO Ltd., Series 2017-53A, Class A(c)	6.68%	01/15/2031	5,513	5,515,980	0.0
Dryden 57 CLO Ltd., Series 2018-57A, Class A(c)	6.39%	05/15/2031	28,750	28,722,022	0.1
Dryden 60 CLO Ltd., Series 2018-60A, Class A(c)	6.61%	07/15/2031	28,531	28,547,732	0.1
Dryden XXVI Senior Loan Fund, Series 2013-26A, Class AR(c)	6.46%	04/15/2029	3,047	3,050,858	0.0
Eaton Vance CLO Ltd., Series 2014-1RA, Class D(c)	8.61%	07/15/2030	1,500	1,495,584	0.0
Elmwood CLO 15 Ltd., Series 2022-2A, Class D(c)	8.95%	04/22/2035	3,550	3,565,538	0.0
Galaxy Xxviii CLO Ltd., Series 2018-28A, Class A1(c)	6.66%	07/15/2031	2,541	2,544,329	0.0
GREYWOLF CLO VI Ltd., Series 2018-1A, Class A1(c)	6.57%	04/26/2031	29,276	29,305,469	0.1
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class D(c)	8.61%	04/15/2034	8,000	8,006,000	0.0
Juniper Valley Park CLO Ltd., Series 2023-1A, Class AR(c)	6.53%	07/20/2036	8,740	8,743,444	0.0
KKR CLO 21 Ltd., Series 21, Class A(c)	6.56%	04/15/2031	12,137	12,143,869	0.1
LCM XIV LP, Series 14A, Class AR(c)	6.58%	07/20/2031	14,384	14,395,735	0.1
LCM XVIII LP, Series 18A, Class A1R(c)	6.56%	04/20/2031	2,867	2,868,690	0.0
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class DR(c)	8.29%	10/20/2030	6,000	6,000,576	0.0
Mountain View CLO IX Ltd., Series 2015-9A, Class A1R(c)	6.68%	07/15/2031	19,316	19,316,174	0.1
Nassau Ltd., Series 2017-IIA, Class AL(c)	6.81%	01/15/2030	934	934,475	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 Ltd., Series 2019-33A, Class CR(c)	7.45%	10/16/2033	12,000	12,028,512	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 Ltd., Series 2019-33A, Class DR(c)	8.45%	10/16/2033	1,875	1,878,703	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 Ltd., Series 2020-39A, Class DR(c)	9.18%	04/20/2038	1,000	1,011,573	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 Ltd., Series 2021-42A, Class D(c)	8.35%	07/16/2035	4,000	4,002,452	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 43 Ltd., Series 2021-43A, Class D(c)	8.65%	07/17/2035	11,050	11,071,492	0.1
New Mountain CLO 3 Ltd., Series CLO-3A, Class D(c)	8.89%	10/20/2034	11,950	11,963,109	0.1
Northwoods Capital XII-B Ltd., Series 2018-12BA, Class B(c)	7.45%	06/15/2031	5,400	5,403,083	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettövermögen %
OCP CLO Ltd., Series 2014-5A, Class A1R(c)	6.62%	04/26/2031	USD 11,487	\$ 11,494,058	0.1%
OCP CLO Ltd., Series 2018-15A, Class A1(c)	6.64%	07/20/2031	8,439	8,440,843	0.0
Octagon Investment Partners 35 Ltd., Series 2018-1A, Class A1A(c)	6.60%	01/20/2031	11,585	11,596,752	0.1
Octagon Investment Partners 35 Ltd., Series 2018-1A, Class D(c)	10.74%	01/20/2031	2,750	2,525,482	0.0
Octagon Investment Partners 36 Ltd., Series 2018-1A, Class A1(c)	6.53%	04/15/2031	15,992	15,998,410	0.1
Octagon Investment Partners XVI Ltd., Series 2013-1A, Class A1R(c)	6.57%	07/17/2030	2,184	2,185,376	0.0
OZLM XVIII Ltd., Series 2018-18A, Class A(c)	6.58%	04/15/2031	11,379	11,390,554	0.1
OZLM XVIII Ltd., Series 2018-18A, Class B(c)	7.11%	04/15/2031	3,000	3,000,897	0.0
OZLM XXII Ltd., Series 2018-22A, Class A1(c)	6.62%	01/17/2031	4,925	4,927,743	0.0
Pikes Peak CLO 10, Series 2022-10A, Class D(c)	9.11%	04/22/2034	8,650	8,673,770	0.0
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class D(c)	8.64%	07/20/2034	4,000	4,000,816	0.0
PPM CLO Ltd., Series 2018-1A, Class A(c)	6.71%	07/15/2031	10,452	10,457,935	0.0
Regatta XVI Funding Ltd., Series 2019-2A, Class A1R(c)	6.26%	01/15/2033	57,750	57,750,000	0.2
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2018-1A, Class A(c)	6.49%	05/20/2031	11,685	11,696,211	0.1
Shackleton CLO Ltd., Series 2014-5RA, Class A(c)	6.49%	05/07/2031	24,774	24,775,139	0.1
Sound Point CLO XIX Ltd., Series 2018-1A, Class A(c)	6.56%	04/15/2031	26,631	26,639,018	0.1
Sounds Point CLO IV-R Ltd., Series 2013-3RA, Class A(c)	6.69%	04/18/2031	5,507	5,510,629	0.0
Venture 31 CLO Ltd., Series 2018-31A, Class A1(c)	6.57%	04/20/2031	4,755	4,744,637	0.0
Venture XXVII CLO Ltd., Series 2017-27A, Class D(c)	9.54%	07/20/2030	17,169	17,076,295	0.1
VERDE CLO Ltd., Series 2019-1A, Class ARR(c)	6.23%	04/15/2032	49,755	49,763,757	0.2
Voya CLO Ltd., Series 2013-3A, Class A1RR(c)	6.69%	10/18/2031	8,830	8,851,104	0.0
Voya CLO Ltd., Series 2018-1A, Class A1(c)	6.49%	04/19/2031	10,372	10,378,963	0.0
Voya CLO Ltd., Series 2018-3A, Class A1R2(c)	6.50%	10/15/2031	36,562	36,610,905	0.1
Wehle Park CLO Ltd., Series 2022-1A, Class D(c)	8.63%	04/21/2035	7,000	7,023,912	0.0
Wellfleet CLO Ltd., Series 2018-1A, Class A(c)	6.65%	07/17/2031	6,102	6,106,885	0.0
Wind River CLO Ltd., Series 2014-1A, Class ARR(c)	6.59%	07/18/2031	2,249	2,250,717	0.0
				1,020,831,405	3.7
BEHÖRDEN					
SCHULDVERSCHREIBUNGEN VON BEHÖRDEN					
Federal Home Loan Banks	3.25%	06/09/2028	34,000	33,268,608	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp.	6.25%	07/15/2032	119,285	137,666,139	0.5
Federal Home Loan Mortgage Corp.	6.75%	03/15/2031	65,181	75,608,914	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series GDIF	6.75%	09/15/2029	8,750	9,921,981	0.0
Federal National Mortgage Association	6.25%	05/15/2029	120,037	132,736,643	0.5
Federal National Mortgage Association	6.63%	11/15/2030	358,671	411,274,776	1.5
Federal National Mortgage Association	7.13%	01/15/2030	142,912	165,452,565	0.6
Federal National Mortgage Association	7.25%	05/15/2030	15,000	17,581,549	0.1
Tennessee Valley Authority	7.13%	05/01/2030	19,383	22,443,462	0.1
				1,005,954,637	3.7
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB FCPI - Emerging Markets Debt Portfolio - Class SA			721,651	49,656,817	0.2
AB SICAV I - Asia Income Opportunities Portfolio - Class ZT			2,801,175	233,926,102	0.9
AB SICAV I - Global Income Portfolio - Class ZT			1,159,244	91,348,439	0.3
AB SICAV I - Sustainable Income Portfolio - Class S			856,251	85,976,126	0.3
AB SICAV I - US High Yield Portfolio - Class ZT			4,317,024	58,841,044	0.2
AB SICAV I - USD Corporate Bond Portfolio - Class ZT			250,000	25,545,000	0.1
				545,293,528	2.0
QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
ASERBAIDSCHAN					
Southern Gas Corridor CJSC	6.88%	03/24/2026	USD 27,801	28,270,142	0.1
CHILE					
Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.00%	09/30/2029	19,310	17,529,859	0.1
Corp. Nacional del Cobre de Chile	5.13%	02/02/2033	2,373	2,333,697	0.0
Corp. Nacional del Cobre de Chile	5.95%	01/08/2034	19,472	20,202,200	0.1
Corp. Nacional del Cobre de Chile	6.44%	01/26/2036	13,291	14,250,444	0.1
Empresa Nacional del Petroleo	5.95%	07/30/2034	10,902	11,310,825	0.0
				65,627,025	0.3
UNGARN					
Magyar Export-Import Bank Zrt	6.13%	12/04/2027	6,506	6,625,954	0.0
MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt	6.50%	06/29/2028	5,381	5,576,061	0.0
				12,202,015	0.0
INDONESIEN					
Indonesia Asahan Aluminium PT/ Mineral Industri Indonesia Persero PT	5.45%	05/15/2030	4,342	4,382,424	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Indonesia Asahan Aluminium PT/ Mineral Industri Indonesia Persero PT	6.53%	11/15/2028	USD 16,240	\$ 17,102,750	0.1%
				21,485,174	0.1
MEXIKO					
Comision Federal de Electricidad	3.35%	02/09/2031	19,438	16,734,903	0.1
Comision Federal de Electricidad	3.88%	07/26/2033	10,400	8,768,552	0.0
Comision Federal de Electricidad	4.69%	05/15/2029	32,524	31,334,841	0.1
Petroleos Mexicanos	6.38%	01/23/2045	9,884	6,650,079	0.0
Petroleos Mexicanos	6.49%	01/23/2027	10,352	10,043,407	0.0
Petroleos Mexicanos	6.50%	01/23/2029	6,902	6,334,742	0.0
Petroleos Mexicanos	6.70%	02/16/2032	7,604	6,528,034	0.0
Petroleos Mexicanos	8.75%	06/02/2029	66,470	65,904,660	0.3
				152,299,218	0.5
PANAMA					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA.	4.00%	08/11/2041	6,707	5,387,599	0.0
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA.	5.13%	08/11/2061	3,542	2,782,701	0.0
				8,170,300	0.0
SÜDAFRIKA					
Transnet SOC Ltd.	8.25%	02/06/2028	17,800	18,306,232	0.1
TRINIDAD UND TOBAGO					
Trinidad Generation UnLtd.	5.25%	11/04/2027	5,445	5,300,708	0.0
Trinidad Generation UnLtd.	5.25%	11/04/2027	2,929	2,851,382	0.0
				314,512,196	1.1
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICS					
Series 3119, Class PI(c) (f)	1.73%	02/15/2036	2,553	382,383	0.0
Series 3725, Class CS(c) (f)	0.53%	05/15/2040	12,821	826,904	0.0
Series 3898, Class NS(c) (f)	0.46%	07/15/2041	4,057	354,692	0.0
Series 3921, Class SB(c) (f)	1.09%	09/15/2041	8,768	1,250,717	0.0
Series 3928, Class SE(c) (f)	1.11%	09/15/2041	7,870	998,863	0.0
Series 4125, Class SA(c) (f)	0.68%	11/15/2042	5,513	721,893	0.0
Series 4248, Class SL(c) (f)	0.58%	05/15/2041	1,476	135,013	0.0
Series 4292, Class S(c) (f)	0.58%	01/15/2044	1,940	250,513	0.0
Series 4317, Class SD(c) (f)	1.73%	08/15/2035	4,604	587,134	0.0
Series 4372, Class JS(c) (f)	0.63%	08/15/2044	11,819	1,492,283	0.0
Series 4373, Class SA(c) (f)	0.68%	08/15/2044	7,449	953,393	0.0
Series 4494, Class SL(c) (f)	0.75%	07/15/2045	23,832	3,035,447	0.0
Series 4495, Class SA(c) (f)	0.68%	07/15/2045	5,836	818,842	0.0
Series 4570, Class ST(c) (f)	0.53%	04/15/2046	6,620	898,614	0.0
Series 4585, Class DS(c) (f)	0.53%	05/15/2046	12,235	1,533,431	0.0
Series 4593, Class SA(c) (f)	0.53%	06/15/2046	8,774	1,106,495	0.0
Series 4656, Class SK(c) (f)	0.58%	02/15/2047	6,230	847,150	0.0
Series 4707, Class LS(c) (f)	0.68%	08/15/2047	7,651	973,910	0.0
Series 4719, Class SA(c) (f)	0.68%	09/15/2047	6,663	892,701	0.0
Series 4719, Class SB(c) (f)	0.68%	09/15/2047	12,687	1,774,380	0.0
Series 4727, Class AS(c) (f)	0.73%	11/15/2047	10,429	1,544,443	0.0
Series 4735, Class SA(c) (f)	0.73%	12/15/2047	19,464	2,688,634	0.0
Series 4736, Class LS(c) (f)	0.73%	12/15/2047	8,659	1,220,164	0.0
Series 4736, Class SM(c) (f)	0.73%	12/15/2047	17,324	2,310,464	0.0
Series 4754, Class QS(c) (f)	0.68%	02/15/2048	10,128	1,507,566	0.0
Series 4767, Class SB(c) (f)	0.73%	03/15/2048	4,330	561,490	0.0
Series 4824, Class KS(c) (f)	0.73%	09/15/2048	3,952	521,350	0.0
Series 4927, Class SJ(c) (f)	0.59%	11/25/2049	12,760	1,445,586	0.0
Series 4932, Class SM(c) (f)	0.59%	06/25/2049	18,522	2,296,555	0.0
Series 4954, Class SL(c) (f)	0.59%	02/25/2050	204	24,064	0.0
Series 4981, Class HS(c) (f)	0.64%	06/25/2050	56,107	6,192,751	0.1
Series 4981, Class JS(c) (f)	0.64%	06/25/2050	85,158	12,807,060	0.1
Federal National Mortgage Association REMICS					
Series 2005-58, Class IK(c) (f)	0.54%	07/25/2035	5,581	644,285	0.0
Series 2006-8, Class JH(c) (f)	1.14%	03/25/2036	6,031	776,717	0.0
Series 2011-146, Class SA(c) (f)	0.54%	01/25/2042	6,712	848,890	0.0
Series 2012-7, Class QS(c) (f)	0.54%	02/25/2042	8,530	1,081,944	0.0
Series 2012-17, Class ES(c) (f)	1.09%	03/25/2041	548	21,315	0.0
Series 2012-17, Class SE(c) (f)	0.49%	03/25/2042	6,407	923,403	0.0
Series 2012-70, Class HS(c) (f)	0.54%	07/25/2042	9,766	1,468,543	0.0
Series 2012-122, Class LS(c) (f)	0.64%	11/25/2042	5,647	790,367	0.0
Series 2012-122, Class MS(c) (f)	0.64%	11/25/2042	6,211	926,507	0.0
Series 2013-4, Class ST(c) (f)	0.69%	02/25/2043	6,058	811,732	0.0
Series 2013-15, Class SA(c) (f)	0.69%	03/25/2043	5,199	722,307	0.0
Series 2013-62, Class SA(c) (f)	1.24%	06/25/2043	8,434	1,486,206	0.0
Series 2014-17, Class SB(c) (f)	0.59%	04/25/2044	6,595	844,650	0.0
Series 2014-28, Class SB(c) (f)	0.59%	05/25/2044	6,015	910,141	0.0
Series 2014-35, Class CS(c) (f)	0.69%	06/25/2044	7,900	755,799	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2014-40, Class HS(c) (f)	1.24%	07/25/2044	USD 3,925	\$ 724,738	0.0%
Series 2014-78, Class SA(c) (f)	0.64%	12/25/2044	3,403	472,249	0.0
Series 2014-88, Class BS(c) (f)	0.69%	01/25/2045	5,930	763,722	0.0
Series 2015-26, Class SH(c) (f)	0.99%	05/25/2045	8,657	1,323,168	0.0
Series 2015-57, Class AS(c) (f)	0.79%	08/25/2045	32,304	2,943,550	0.0
Series 2015-90, Class SL(c) (f)	0.69%	12/25/2045	6,809	934,018	0.0
Series 2016-29, Class SA(c) (f)	0.54%	05/25/2046	8,222	1,129,912	0.0
Series 2016-60, Class SA(c) (f)	0.64%	09/25/2046	17,478	1,681,419	0.0
Series 2016-65, Class AS(c) (f)	0.64%	09/25/2046	8,204	931,075	0.0
Series 2016-89, Class SH(c) (f)	0.54%	12/25/2046	4,394	560,997	0.0
Series 2017-20, Class SJ(c) (f)	0.64%	04/25/2047	17,898	2,429,786	0.0
Series 2017-26, Class TS(c) (f)	0.49%	04/25/2047	6,125	881,637	0.0
Series 2017-35, Class LS(c) (f)	0.69%	05/25/2047	18,350	2,772,533	0.0
Series 2017-38, Class DS(c) (f)	0.74%	05/25/2047	4,087	174,520	0.0
Series 2017-38, Class SE(c) (f)	0.64%	05/25/2047	13,384	1,856,930	0.0
Series 2017-49, Class SP(c) (f)	0.69%	07/25/2047	5,475	802,180	0.0
Series 2017-81, Class CS(c) (f)	0.74%	10/25/2047	6,281	787,683	0.0
Series 2017-85, Class HS(c) (f)	0.74%	11/25/2047	9,900	1,373,486	0.0
Series 2017-105, Class SE(c) (f)	0.69%	01/25/2048	29,248	4,146,202	0.0
Series 2017-109, Class SJ(c) (f)	0.74%	01/25/2048	2,374	337,505	0.0
Series 2017-112, Class SA(c) (f)	0.69%	01/25/2048	7,923	1,092,227	0.0
Series 2018-13, Class SG(c) (f)	0.69%	03/25/2048	5,606	653,066	0.0
Series 2018-28, Class PS(c) (f)	0.74%	05/25/2048	9,982	1,312,674	0.0
Series 2018-28, Class SB(c) (f)	0.74%	05/25/2048	10,535	1,418,454	0.0
Series 2018-30, Class SA(c) (f)	0.74%	05/25/2048	10,345	1,468,682	0.0
Series 2018-32, Class SB(c) (f)	0.74%	05/25/2048	10,420	1,545,150	0.0
Series 2018-39, Class AS(c) (f)	0.74%	06/25/2048	4,981	661,930	0.0
Series 2018-45, Class SL(c) (f)	0.74%	06/25/2048	7,805	1,061,950	0.0
Series 2018-47, Class SD(c) (f)	0.74%	07/25/2048	15,916	2,252,866	0.0
Series 2018-63, Class KS(c) (f)	0.74%	09/25/2048	4,380	497,822	0.0
Series 2018-96, Class SC(c) (f)	0.59%	10/25/2035	3,759	336,016	0.0
Series 2019-13, Class SA(c) (f)	0.54%	04/25/2049	9,579	1,212,013	0.0
Series 2019-25, Class SA(c) (f)	0.59%	06/25/2049	22,684	2,599,191	0.0
Series 2019-31, Class SJ(c) (f)	0.64%	07/25/2049	5,081	499,393	0.0
Series 2019-37, Class US(c) (f)	0.59%	07/25/2049	7,674	860,056	0.0
Series 2019-38, Class SM(c) (f)	0.59%	07/25/2049	4,954	553,253	0.0
Series 2019-42, Class SQ(c) (f)	0.59%	08/25/2049	14,540	1,643,386	0.0
Series 2019-48, Class SA(c) (f)	0.74%	12/25/2039	18,137	2,254,443	0.0
Series 2019-48, Class SM(c) (f)	0.59%	07/25/2039	6,718	778,803	0.0
Series 2019-60, Class SJ(c) (f)	0.59%	10/25/2049	15,302	2,138,484	0.0
Series 2019-65, Class SY(c) (f)	0.59%	11/25/2049	10,238	1,213,561	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2014-160, Class SP(c) (f)	0.15%	10/20/2044	10,125	1,422,621	0.0
Series 2017-52, Class SN(c) (f)	0.70%	04/20/2047	3,432	386,767	0.0
Series 2017-103, Class SL(c) (f)	0.75%	07/20/2047	12,128	1,476,137	0.0
Series 2017-115, Class SA(c) (f)	0.75%	07/20/2047	9,634	1,185,981	0.0
Series 2017-122, Class SA(c) (f)	0.75%	08/20/2047	12,044	1,736,479	0.0
Series 2017-134, Class SE(c) (f)	0.75%	09/20/2047	5,405	659,188	0.0
Series 2017-149, Class SG(c) (f)	0.75%	10/20/2047	9,643	1,088,979	0.0
Series 2020-47, Class SG(c) (f)	0.55%	02/20/2049	11,487	1,156,395	0.0
				128,160,968	0.2
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICS					
Series 4398, Class IO(g)	6.00%	10/15/2037	9,609	1,587,512	0.0
Series 4913, Class IO(g)	6.00%	04/15/2041	4,401	811,655	0.0
Series 4933, Class IO(g)	5.00%	03/15/2049	5,289	704,905	0.0
Series 4976, Class MI(g)	4.50%	05/25/2050	25,601	5,884,162	0.1
Series 4981, Class MI(g)	5.00%	06/25/2050	35,717	7,621,961	0.1
Series 4987, Class IC(g)	4.50%	06/25/2050	87,242	19,438,878	0.1
Series 4993, Class LI(g)	5.00%	07/25/2050	10,255	2,008,601	0.0
Series 5008, Class AI(g)	3.50%	09/25/2050	12,267	2,312,328	0.0
Series 5011, Class MI(g)	3.00%	09/25/2050	11,753	1,943,191	0.0
Series 5013, Class JI(g)	4.00%	09/25/2050	20,138	4,191,546	0.0
Series 5015, Class BI(g)	4.00%	09/25/2050	16,350	3,269,119	0.0
Series 5018, Class AI(g)	4.00%	10/25/2050	8,586	1,719,492	0.0
Series 5018, Class GI(g)	4.50%	10/25/2050	13,686	3,057,777	0.0
Series 5024, Class DI(g)	4.00%	10/25/2050	4,310	895,869	0.0
Series 5030, Class EI(g)	3.50%	10/25/2050	4,130	719,669	0.0
Series 5036, Class IT(g)	4.00%	03/25/2050	5,821	1,192,295	0.0
Series 5040, Class AI(g)	3.50%	11/25/2050	1,738	298,395	0.0
Series 5043, Class IO(g)	5.00%	11/25/2050	11,530	2,586,164	0.0
Series 5049, Class CI(g)	3.50%	12/25/2050	19,816	3,575,874	0.0
Series 5052, Class IK(g)	4.00%	12/25/2050	17,624	3,604,415	0.0
Federal National Mortgage Association REMICS					
Series 2010-109, Class IM(g)	5.50%	09/25/2040	1,423	158,023	0.0
Series 2014-37, Class AI(g)	5.50%	07/25/2044	3,106	518,890	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Series 2015-22, Class EI(g)	6.00%	04/25/2045	USD 13,063	\$ 1,970,060	0.0%
Series 2016-11, Class GI(g)	5.00%	03/25/2046	2,856	454,631	0.0
Series 2016-26, Class IO(g)	5.00%	05/25/2046	9,568	1,321,544	0.0
Series 2016-33, Class NI(g)	5.00%	07/25/2034	11,127	1,658,945	0.0
Series 2016-34, Class AI(g)	5.00%	06/25/2046	9,992	1,382,981	0.0
Series 2016-37, Class BI(g)	5.00%	06/25/2046	17,551	2,541,502	0.0
Series 2016-64, Class BI(g)	5.00%	09/25/2046	15,315	1,984,288	0.0
Series 2018-54, Class IO(g)	5.50%	08/25/2048	5,832	1,135,146	0.0
Series 2020-89, Class KI(g)	4.00%	12/25/2050	59,358	11,431,797	0.1
Series 2020-96, Class KI(g)	2.50%	01/25/2051	6,396	998,359	0.0
Series 2021-18, Class IT(g)	3.00%	04/25/2051	11,347	1,838,353	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2015-62, Class GI(g)	6.50%	05/20/2045	10,611	1,601,869	0.0
Series 2019-57, Class IO(g)	5.50%	05/20/2049	3,706	570,195	0.0
				<u>96,990,391</u>	<u>0.4</u>
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Connecticut Avenue Securities Trust,					
Series 2023-R07, Class 2M1(c)	7.30%	09/25/2043	22,943	23,072,298	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes 2023-HQA3,					
Series 2023-HQA3, Class A1(c)	7.20%	11/25/2043	14,411	14,586,526	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt					
Notes 2014-HQ2, Series 2014-HQ2, Class M3(c)	9.21%	09/25/2024	990	991,652	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes					
2015-HQA2, Series 2015-HQA2, Class M3(c)	10.26%	05/25/2028	6,776	7,014,967	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes					
2016-HQA3, Series 2016-HQA3, Class M3(c)	9.31%	03/25/2029	1,322	1,374,703	0.0
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
Series 2015-C04, Class 2M2(c)	11.01%	04/25/2028	11,760	11,961,415	0.1
Series 2016-C01, Class 2M2(c)	12.41%	08/25/2028	2,933	3,078,326	0.0
Series 2016-C02, Class 1M2(c)	11.46%	09/25/2028	7,612	7,894,907	0.1
JP Morgan Madison Avenue Securities Trust,					
Series 2015-CH1, Class M2(c)	10.96%	10/25/2025	365	374,564	0.0
Oaktown Re V Ltd., Series 2020-2A, Class M2(c)	10.71%	10/25/2030	959	971,168	0.0
PMT Credit Risk Transfer Trust					
Series 2019-3R, Class A(c)	9.16%	11/27/2031	3,479	3,490,030	0.0
Series 2020-1R, Class A(c)	8.81%	02/25/2025	9,201	9,186,841	0.1
Wells Fargo Credit Risk Transfer Securities Trust,					
Series 2015-WF1, Class 1M2(c)	10.71%	11/25/2025	437	451,858	0.0
				<u>84,449,255</u>	<u>0.6</u>
				<u>309,600,614</u>	<u>1.2</u>
INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE					
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Inflation Index	1.88%	07/15/2034	254,818	257,455,890	1.0
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Allwyn Entertainment Financing UK PLC	7.88%	04/30/2029	18,734	19,548,317	0.1
Melco Resorts Finance Ltd.	5.38%	12/04/2029	23,398	21,336,636	0.1
Melco Resorts Finance Ltd.	5.63%	07/17/2027	9,002	8,670,051	0.0
Melco Resorts Finance Ltd.	5.75%	07/21/2028	9,495	9,041,614	0.0
Melco Resorts Finance Ltd.	7.63%	04/17/2032	15,141	15,159,284	0.1
MGM China Holdings Ltd.	5.25%	06/18/2025	8,970	8,901,290	0.0
MGM China Holdings Ltd.	5.88%	05/15/2026	7,869	7,834,573	0.0
MGM China Holdings Ltd.	7.13%	06/26/2031	1,400	1,431,931	0.0
Wynn Macau Ltd.	4.88%	10/01/2024	953	950,389	0.0
Wynn Macau Ltd.	5.13%	12/15/2029	1,400	1,287,125	0.0
Wynn Macau Ltd.	5.50%	01/15/2026	30,257	29,878,788	0.1
Wynn Macau Ltd.	5.50%	10/01/2027	14,203	13,732,029	0.0
Wynn Macau Ltd.	5.63%	08/26/2028	17,608	16,780,424	0.1
				<u>154,552,451</u>	<u>0.5</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	4.75%	05/09/2027	25,018	24,545,160	0.1
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	5.13%	05/09/2029	19,409	19,227,138	0.1
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	7.88%	09/15/2029	6,357	7,003,968	0.0
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	8.13%	09/15/2031	6,785	7,760,746	0.0
				<u>58,537,012</u>	<u>0.2</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ENERGIE					
Leviathan Bond Ltd.	6.13%	06/30/2025	USD 17,742	\$ 17,462,879	0.1%
Leviathan Bond Ltd.	6.50%	06/30/2027	21,269	20,365,160	0.1
				37,828,039	0.2
				250,917,502	0.9
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E.	4.80%	02/10/2036	12,568	9,671,173	0.1
Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust, Series 2016-UB10, Class C.	4.98%	07/15/2049	2,354	2,235,369	0.0
Benchmark Mortgage Trust Series 2018-B1, Class A5.	3.67%	01/15/2051	1,200	1,149,291	0.0
Series 2019-B11, Class XA(g).	1.12%	05/15/2052	199,519	6,922,785	0.0
CCUBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class XA(g).	1.16%	11/15/2050	6,054	143,939	0.0
CD Mortgage Trust, Series 2017-CD3, Class XA(g).	1.10%	02/10/2050	94,430	1,779,086	0.0
Citigroup Commercial Mortgage Trust Series 2015-GC29, Class XA(g).	1.15%	04/10/2048	28,855	75,634	0.0
Series 2016-C3, Class XA(g).	1.05%	11/15/2049	141,144	2,162,094	0.0
Series 2016-GC36, Class A5.	3.62%	02/10/2049	13,574	13,168,058	0.1
Series 2016-P3, Class XA(g).	1.81%	04/15/2049	105,411	1,524,554	0.0
Series 2017-P7, Class XA(g).	1.24%	04/14/2050	74,613	1,582,814	0.0
Commercial Mortgage Trust Series 2012-CR3, Class E.	4.43%	10/15/2045	2,959	1,624,106	0.0
Series 2014-CR16, Class D.	4.95%	04/10/2047	12,900	10,578,063	0.1
Series 2014-LC17, Class B.	4.49%	10/10/2047	3,622	3,611,738	0.0
Series 2014-UBS6, Class AM.	4.05%	12/10/2047	390	383,567	0.0
Series 2015-CR27, Class XA(g).	1.05%	10/10/2048	23,315	144,616	0.0
Series 2015-LC21, Class XA(g).	0.75%	07/10/2048	61,739	141,346	0.0
Series 2015-PC1, Class C.	4.42%	07/10/2050	11,346	10,020,845	0.1
Series 2016-DC2, Class XA(g).	1.07%	02/10/2049	1,338	11,383	0.0
Series 2017-COR2, Class XA(g).	1.30%	09/10/2050	20,869	540,032	0.0
GS Mortgage Securities Trust Series 2011-GC5, Class D.	5.30%	08/10/2044	3,699	1,910,378	0.0
Series 2013-GC13, Class D.	4.00%	07/10/2046	17,538	11,128,499	0.1
Series 2016-GS3, Class XA(g).	1.31%	10/10/2049	109,123	1,897,281	0.0
Series 2017-GS5, Class XA(g).	0.97%	03/10/2050	129,194	2,138,448	0.0
Series 2017-GS7, Class XA(g).	1.22%	08/10/2050	79,644	1,893,312	0.0
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust Series 2012-C6, Class E.	5.13%	05/15/2045	5,000	4,508,901	0.0
Series 2012-LC9, Class E.	3.69%	12/15/2047	10,881	8,874,815	0.1
Series 2013-LC11, Class B.	3.50%	04/15/2046	11,410	9,570,252	0.1
Series 2016-JP2, Class XA(g).	1.94%	08/15/2049	51,372	1,139,107	0.0
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust Series 2014-C22, Class XA(g).	0.67%	09/15/2047	6,230	86	0.0
Series 2014-C24, Class B.	4.12%	11/15/2047	1,355	1,211,501	0.0
Series 2014-C24, Class C.	4.59%	11/15/2047	455	368,567	0.0
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2017-C5, Class XA(g).	1.02%	03/15/2050	123,888	1,843,386	0.0
LCCM, Series 2017-LC26, Class XA(g).	1.68%	07/12/2050	31,697	988,731	0.0
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust Series 2013-C9, Class B.	3.71%	05/15/2046	2,849	2,635,082	0.0
Series 2014-C19, Class D.	3.25%	12/15/2047	4,304	3,413,616	0.0
UBS Commercial Mortgage Trust Series 2017-C1, Class XA(g).	1.65%	06/15/2050	43,905	1,338,598	0.0
Series 2017-C2, Class XA(g).	1.21%	08/15/2050	35,766	863,637	0.0
Series 2017-C4, Class XA(g).	1.24%	10/15/2050	52,987	1,401,764	0.0
Series 2017-C6, Class XA(g).	1.30%	12/15/2050	29,358	804,363	0.0
Series 2018-C10, Class XA(g).	1.02%	05/15/2051	119,821	3,203,796	0.0
Series 2018-C15, Class XA(g).	1.05%	12/15/2051	66,065	2,028,210	0.0
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust Series 2013-C5, Class C.	3.84%	03/10/2046	1,798	1,508,024	0.0
Series 2013-C6, Class D.	4.06%	04/10/2046	7,126	6,142,755	0.0
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust Series 2015-C28, Class B.	4.22%	05/15/2048	2,802	2,700,884	0.0
Series 2015-LC20, Class C.	4.06%	04/15/2050	7,415	6,997,957	0.0
Series 2015-LC20, Class XA(g).	1.42%	04/15/2050	27,837	81,915	0.0
Series 2015-SG1, Class AS.	4.05%	09/15/2048	5,156	5,013,962	0.0
Series 2016-C32, Class XA(g).	1.36%	01/15/2059	100,677	1,209,290	0.0
Series 2016-LC24, Class XA(g).	1.75%	10/15/2049	74,589	1,857,844	0.0
Series 2016-LC25, Class XA(g).	0.96%	12/15/2059	114,737	1,626,265	0.0
Series 2017-C38, Class XA(g).	1.06%	07/15/2050	31,823	626,168	0.0
Series 2017-RC1, Class AS.	3.84%	01/15/2060	2,000	1,917,841	0.0
Series 2018-C48, Class XA(g).	1.10%	01/15/2052	11,189	366,683	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
WFRBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2011-C4, Class E	4.56%	06/15/2044	USD 8,030	\$ 6,504,114	0.0%
Series 2012-C9, Class E	4.88%	11/15/2045	4,263	4,028,475	0.0
Series 2013-C11, Class B	3.71%	03/15/2045	501	478,912	0.0
Series 2014-C22, Class XA(g)	0.74%	09/15/2057	11,526	183	0.0
Series 2014-C24, Class AS	3.93%	11/15/2047	6,846	6,636,988	0.0
Series 2014-C25, Class D	3.80%	11/15/2047	9,035	8,155,263	0.1
				<u>186,486,346</u>	<u>0.8</u>
NICHT STAATLICHE VARIABLE VERZINSLICHE CMBS					
Starwood Retail Property Trust, Series 2014-STAR, Class A(c)	8.50%	11/15/2027	33,050	19,813,743	0.1
				<u>206,300,089</u>	<u>0.9</u>
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
RUMÄNIEN					
Romanian Government International Bond	5.88%	01/30/2029	22,930	23,331,275	0.1
ABS-ANLEIHEN					
AUTOS – FESTVERZINSLICH					
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2019-2A, Class C	4.24%	09/22/2025	667	665,895	0.0
Flagship Credit Auto Trust Series 2019-2, Class E	4.52%	12/15/2026	5,332	5,316,054	0.1
Series 2019-3, Class E	3.84%	12/15/2026	5,230	5,173,784	0.0
				<u>11,155,733</u>	<u>0.1</u>
SONSTIGE ABS – VARIABLE VERZINSLICH					
Pagaya AI Debt, Series 2024-S1, Class ABC(d)	7.20%	09/15/2031	11,068	11,068,356	0.0
				<u>22,224,089</u>	<u>0.1</u>
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE					
BAHRAIN					
Bahrain Government International Bond	5.45%	09/16/2032	16,444	15,616,661	0.1
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN					
VEREINIGTE STAATEN					
State of California, Series 2010	7.60%	11/01/2040	1,600	2,004,905	0.0
State of Illinois, Series 2010	7.35%	07/01/2035	6,030	6,592,190	0.0
				<u>8,597,095</u>	<u>0.0</u>
				<u>25,867,954,790</u>	<u>96.0</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
WR Grace Holdings LLC	4.88%	06/15/2027	26,475	25,927,769	0.1
INVESTITIONSGÜTER					
TK Elevator US Newco, Inc.	5.25%	07/15/2027	23,985	23,593,670	0.1
WESCO Distribution, Inc.	6.38%	03/15/2029	11,398	11,713,638	0.1
WESCO Distribution, Inc.	6.63%	03/15/2032	11,252	11,611,035	0.0
WESCO Distribution, Inc.	7.25%	06/15/2028	8,093	8,303,899	0.0
				<u>55,222,242</u>	<u>0.2</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Univision Communications, Inc.	4.50%	05/01/2029	12,302	10,796,788	0.0
Univision Communications, Inc.	7.38%	06/30/2030	16,494	15,825,874	0.1
Virgin Media Secured Finance PLC	4.50%	08/15/2030	2,646	2,335,413	0.0
				<u>28,958,075</u>	<u>0.1</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Vmed O2 UK Financing I PLC	4.25%	01/31/2031	11,640	10,101,654	0.0
Vmed O2 UK Financing I PLC	7.75%	04/15/2032	67,436	68,666,652	0.3
				<u>78,768,306</u>	<u>0.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd.	5.63%	02/15/2029	9,267	9,181,802	0.0
VOC Escrow Ltd.	5.00%	02/15/2028	62,894	61,786,030	0.2
				<u>70,967,832</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Travel & Leisure Co.	4.63%	03/01/2030	3,108	2,881,461	0.0
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.25%	05/15/2027	11,291	11,215,600	0.0
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	5.13%	10/01/2029	13,465	13,170,600	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	7.13%	02/15/2031	6,200	6,581,667	0.0
				<u>33,849,328</u>	<u>0.1</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Wolverine World Wide, Inc.	4.00%	08/15/2029	USD 7,890	\$ 6,734,923	0.0%
ENERGIE					
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	6.88%	01/15/2029	11,607	11,693,108	0.0
Venture Global Calcasieu Pass LLC	3.88%	11/01/2033	7,231	6,444,064	0.0
Venture Global Calcasieu Pass LLC	4.13%	08/15/2031	7,790	7,225,396	0.0
Venture Global LNG, Inc.	8.13%	06/01/2028	27,783	29,103,416	0.1
Venture Global LNG, Inc.	8.38%	06/01/2031	23,140	24,590,034	0.1
Venture Global LNG, Inc.	9.50%	02/01/2029	12,494	14,079,754	0.1
				<u>93,135,772</u>	<u>0.3</u>
				<u>393,564,247</u>	<u>1.3</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Vistra Corp.(b)	7.00%	12/15/2026	16,102	16,247,327	0.1
Vistra Corp.(b)	8.00%	10/15/2026	19,514	20,172,553	0.1
				<u>36,419,880</u>	<u>0.2</u>
				<u>429,984,127</u>	<u>1.5</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 13 Ltd., Series 2021-13A, Class D(c)	8.69%	10/20/2034	27,834	27,857,195	0.1
AGL CLO 16 Ltd., Series 2021-16A, Class D(c)	8.64%	01/20/2035	5,550	5,552,220	0.0
Apidos Loan Fund Ltd., Series 2024-1A, Class A1(c)	6.59%	04/25/2035	21,115	21,147,137	0.1
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2020-1A, Class A1R(c)	6.53%	04/18/2033	41,175	41,194,641	0.2
Ballyrock CLO 16 Ltd., Series 2021-16A, Class C(c)	8.44%	07/20/2034	3,000	2,960,091	0.0
Ballyrock CLO 17 Ltd., Series 2021-17A, Class C(c)	8.59%	10/20/2034	13,950	13,716,254	0.1
Dryden 49 Senior Loan Fund, Series 2017-49A, Class E(c)	11.84%	07/18/2030	4,717	4,353,682	0.0
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd., Series 2018-1A, Class A2(c)	7.34%	07/21/2031	7,424	7,424,141	0.0
Octagon Investment Partners 38 Ltd., Series 2018-1A, Class B(c)	7.49%	07/20/2030	3,900	3,900,000	0.0
Peace Park CLO Ltd., Series 2021-1A, Class D(c)	8.49%	10/20/2034	27,675	27,702,454	0.1
PPM CLO 5 Ltd., Series 2021-5A, Class D(c)	8.59%	10/18/2034	16,000	15,600,448	0.1
Venture 41 CLO Ltd., Series 2021-41A, Class A1NR(c)	6.71%	01/20/2034	11,850	11,851,801	0.1
Venture XXIX CLO Ltd., Series 2017-29A, Class C(c)	7.88%	09/07/2030	2,300	2,300,856	0.0
				<u>185,560,920</u>	<u>0.8</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Braskem Netherlands Finance BV	7.25%	02/13/2033	17,252	16,950,996	0.1
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Virgolino de Oliveira Finance SA(h) (i)	10.50%	01/28/2018	3,690	369	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(h) (i)	11.75%	02/09/2022	31,151	155,756	0.0
				<u>156,125</u>	<u>0.0</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
JSW Infrastructure Ltd.	4.95%	01/21/2029	644	619,850	0.0
				<u>17,726,971</u>	<u>0.1</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
AES Andes SA	6.35%	10/07/2079	7,106	7,047,944	0.0
Chile Electricity PEC SpA	0.00%	01/25/2028	5,430	4,397,965	0.0
				<u>11,445,909</u>	<u>0.0</u>
STAATSANLEIHEN					
PANAMA					
Panama Notas del Tesoro.	3.75%	04/17/2026	32,276	31,112,127	0.1
				<u>60,285,007</u>	<u>0.2</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
ENERGIE					
Var Energi ASA	7.50%	01/15/2028	16,538	17,640,772	0.1
Var Energi ASA	8.00%	11/15/2032	22,203	25,534,892	0.1
				<u>43,175,664</u>	<u>0.2</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Vistra Operations Co. LLC	6.95%	10/15/2033	12,312	13,622,316	0.1
				<u>56,797,980</u>	<u>0.3</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
Commercial Mortgage Trust, Series 2012-CR3, Class D	4.43%	10/15/2045	USD 3,971	\$ 2,620,860	0.0%
Grantor Trust CMBST(i)	0.00%	11/10/2046	149	6,517,844	0.0
Grantor Trust COMM(i)	0.00%	03/10/2047	142	0	0.0
Grantor Trust CSAIL(i)	4.00%	04/15/2050	207	4,486,011	0.0
Grantor Trust JPMBB(i)	4.00%	11/15/2047	222	3,778,634	0.0
Grantor Trust WFRBS(i)	3.40%	10/15/2057	126	1,512,845	0.0
GS Mortgage Securities Trust(i)	3.49%	07/10/2046	162	6,844,095	0.0
Series 2014-GC22, Class C	4.74%	06/10/2047	993	594,882	0.0
				<u>26,355,171</u>	<u>0.0</u>
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAATSANLEIHEN					
UKRAINE					
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC	7.63%	11/08/2028	14,994	11,845,260	0.1
State Agency of Roads of Ukraine	6.25%	06/24/2030	22,184	6,821,580	0.0
				<u>18,666,840</u>	<u>0.1</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN					
VEREINIGTE STAATEN					
Wisconsin Public Finance Authority, Series 2021	5.75%	07/25/2041	15,000	14,000,042	0.1
				<u>791,650,087</u>	<u>3.0</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$27,987,954,268)				<u>\$ 26,659,604,877</u>	<u>99.0%</u>
Termineinlagen					
ANZ, Hong Kong(j)	3.44 %	–		10,556	0.0
BNP Paribas, Paris(j)	1.71 %	–		12,247,141	0.0
BNP Paribas, Paris(j)	3.30 %	–		8,408	0.0
Citibank, New York(j)	4.68 %	–		133,499,921	0.5
DNB, Oslo(j)	3.05 %	–		114,914	0.0
HSBC, Singapore(j)	2.11 %	–		3,178	0.0
SMBC, London(j)	0.01 %	–		53	0.0
SMBC, London(j)	3.90 %	–		90,345	0.0
SMBC, Tokyo(j)	2.62 %	–		3,081,181	0.0
Standard Chartered Bank, Johannesburg(j)	6.46 %	–		2,390,333	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>151,446,030</u>	<u>0.5</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>129,388,206</u>	<u>0.5</u>
Nettovermögen				<u>\$ 26,940,439,113</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Long					
U.S. Long Bond (CBT) Futures	12/19/2024	6,483	\$ 806,171,180	\$ 798,219,375	\$ (7,951,805)
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	12/31/2024	36,731	7,634,617,279	7,623,404,302	(11,212,976)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	12/31/2024	29,016	3,181,289,125	3,174,305,077	(6,984,048)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	12/19/2024	8,372	955,912,344	950,745,250	(5,167,094)
Short					
U.S. 10 Yr Ultra Futures	12/19/2024	14,938	1,765,801,688	1,754,281,375	11,520,313
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures+	12/19/2024	47	5,366,102	5,337,437	28,664
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	12/19/2024	1,687	225,112,320	222,578,563	2,533,758
					<u>\$ (17,233,188)</u>
				Wertsteigerung	\$ 14,082,735
				Wertminderung	\$ (31,315,923)

+ Zur Absicherung des Portfolios oder der Anteilklassen.

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 1,971,339	USD 1,339,872	09/03/2024	\$ 5,571,485
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD 469,424	USD 349,366	09/03/2024	1,038,023
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF 8,579	USD 10,226	09/03/2024	133,741
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 258,509	USD 289,369	09/03/2024	3,612,729
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 388,789	USD 515,724	09/03/2024	5,127,241

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	2,281,809	USD	15,912	09/03/2024	\$ 303,147
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	NZD	280,882	USD	175,605	09/03/2024	11,121
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	PLN	98,942	USD	25,839	09/03/2024	298,385
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD	622,492	USD	478,914	09/03/2024	1,890,359
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	584,890	AUD	866,343	09/03/2024	1,494,116
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	749,459	AUD	1,104,996	09/03/2024	(1,542,486)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	203,789	CAD	277,365	09/03/2024	2,024,649
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	142,559	CAD	192,059	09/03/2024	(44,882)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	10,076	CHF	8,579	09/03/2024	16,318
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	287,965	EUR	258,509	09/03/2024	(2,208,549)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	250,793	GBP	192,353	09/03/2024	1,824,214
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	259,334	GBP	196,436	09/03/2024	(1,354,535)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	15,782	JPY	2,281,809	09/03/2024	(173,728)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	172,902	NZD	280,882	09/03/2024	2,691,846
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	25,743	PLN	98,942	09/03/2024	(202,284)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	477,810	SGD	622,492	09/03/2024	(786,350)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	143,018	ZAR	2,554,706	09/03/2024	273,357
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR	2,554,706	USD	144,132	09/03/2024	840,787
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	AUD	1,335	USD	907	09/09/2024	3,523
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	AUD	2,589,146	USD	1,722,497	09/09/2024	(30,218,281)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CAD	551,180	USD	402,936	09/09/2024	(6,127,725)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CNH	7,646	USD	1,074	09/09/2024	(5,271)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR	131,800	USD	146,763	09/09/2024	1,038,239
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR	257,429	USD	282,442	09/09/2024	(2,184,725)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	GBP	162	USD	214	09/09/2024	2,099
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	GBP	574,744	USD	740,088	09/09/2024	(14,772,320)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	PLN	99,236	USD	25,819	09/09/2024	203,814
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	PLN	194,100	USD	49,429	09/09/2024	(673,196)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD	327,268	USD	251,113	09/09/2024	242,864
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD	648,410	USD	491,151	09/09/2024	(5,891,506)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	1,719,088	AUD	2,584,119	09/09/2024	30,224,333
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	594,391	AUD	874,804	09/09/2024	(2,195,357)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	403,838	CAD	552,398	09/09/2024	6,128,767
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	138,860	CAD	186,649	09/09/2024	(337,115)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	156,417	CNH	1,120,592	09/09/2024	1,790,481
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	282,876	EUR	257,819	09/09/2024	2,182,217
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	292,517	EUR	262,054	09/09/2024	(2,775,905)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	737,425	GBP	572,726	09/09/2024	14,784,827
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	258,637	GBP	195,012	09/09/2024	(2,511,474)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	49,345	PLN	193,774	09/09/2024	673,619
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	51,766	PLN	198,594	09/09/2024	(503,814)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	490,077	SGD	647,008	09/09/2024	5,891,249
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	503,688	SGD	655,699	09/09/2024	(1,057,623)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	146,417	ZAR	2,652,013	09/09/2024	2,272,044
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	59,800	ZAR	1,059,217	09/09/2024	(413,143)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR	662	USD	37	09/09/2024	152
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR	2,707,679	USD	149,562	09/09/2024	(2,247,855)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CAD	178,721	USD	131,287	09/23/2024	(1,411,285)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CHF	17,085	USD	20,027	09/23/2024	(117,094)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	EUR	255,009	USD	283,773	09/23/2024	1,640,774
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	NZD	1,282	USD	802	09/23/2024	188
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	NZD	563,599	USD	346,749	09/23/2024	(5,608,130)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD	296,517	USD	227,689	09/23/2024	199,267
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD	295,018	USD	226,166	09/23/2024	(173,414)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	131,317	CAD	178,763	09/23/2024	1,411,579
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	67,881	CAD	91,200	09/23/2024	(165,594)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	19,940	CHF	17,011	09/23/2024	117,112
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	10,436	CHF	8,756	09/23/2024	(112,358)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	427,319	EUR	383,203	09/23/2024	(3,357,277)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	523,563	NZD	846,417	09/23/2024	5,609,839
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	257	NZD	410	09/23/2024	(82)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	225,955	SGD	294,743	09/23/2024	173,117
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	455,938	SGD	593,070	09/23/2024	(931,577)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	165,163	ZAR	2,953,177	09/23/2024	219,109
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	92,061	ZAR	1,632,546	09/23/2024	(635,966)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR	662	USD	37	09/23/2024	155
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	ZAR	3,007,626	USD	168,237	09/23/2024	(195,169)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	JPY	4,649,524	USD	32,064	09/24/2024	166,510
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	47,381	JPY	6,845,428	09/24/2024	(418,966)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	AUD	1,106,096	USD	750,201	09/30/2024	1,049,709
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CNH	225	USD	32	09/30/2024	(128)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	GBP	196,597	USD	259,543	09/30/2024	1,287,738
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	1,502,849	AUD	2,213,193	09/30/2024	(3,870,520)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	154,792	CNH	1,097,974	09/30/2024	609,457
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	37	EUR	33	09/30/2024	(292)

Kontrahent		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	520,769	GBP	393,512	09/30/2024	\$ (3,841,742)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD	192,059	USD	142,558	10/01/2024	(79,591)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	143,461	CAD	193,277	10/01/2024	80,693
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	143,201	CAD	192,349	10/01/2024	(349,127)
						<u>\$ 5,658,557</u>
					Wertsteigerung	\$ 105,154,993
					Wertminderung	\$ (99,496,436)

+ Zur Absicherung des Portfolios oder der Anteilklassen.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nomineller Betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Verkaufskontrakte Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 42, 5 Year Index, 06/20/2029	06/20/2029	USD1,171,080	\$ 83,743,498	\$ 10,824,316

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nomineller Betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)	
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen		
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 770,000	09/11/2024	1 Day SOFR	9.000%	\$ (1,407,935)	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 493,000	04/12/2026	1 Day SOFR	4.817%	7,119,295	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 366,000	04/26/2026	1 Day SOFR	4.863%	5,776,117	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 600,000	09/29/2028	4.455%	1 Day SOFR	(22,774,374)	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 207,000	04/08/2029	1 Day SOFR	4.104%	5,852,643	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 108,000	04/09/2029	1 Day SOFR	4.120%	3,126,768	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 103,000	04/10/2029	1 Day SOFR	4.197%	3,322,199	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 103,500	04/11/2029	1 Day SOFR	4.136%	3,071,321	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 470,500	04/12/2029	1 Day SOFR	4.306%	17,366,480	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 103,500	04/12/2029	1 Day SOFR	4.367%	4,085,470	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 102,500	04/15/2029	1 Day SOFR	4.381%	4,117,927	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 103,000	04/16/2029	1 Day SOFR	4.289%	3,738,270	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 102,000	04/17/2029	1 Day SOFR	4.383%	4,111,901	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 102,500	04/18/2029	1 Day SOFR	4.438%	4,374,203	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 102,500	04/19/2029	1 Day SOFR	4.382%	4,130,734	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 102,000	04/22/2029	1 Day SOFR	4.383%	4,125,766	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 102,000	04/23/2029	1 Day SOFR	4.397%	4,188,915	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 102,000	04/24/2029	1 Day SOFR	4.406%	4,231,152	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 204,000	04/25/2029	1 Day SOFR	4.362%	8,085,303	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 203,500	04/26/2029	1 Day SOFR	4.423%	8,599,969	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 202,500	04/29/2029	1 Day SOFR	4.474%	9,017,123	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 203,000	04/30/2029	1 Day SOFR	4.456%	8,887,647	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 286,000	04/12/2034	1 Day SOFR	4.114%	15,458,446	
Insgesamt					<u>\$ 108,605,340</u>	
					Wertsteigerung	\$ 132,787,649
					Wertminderung	\$ (24,182,309)
Swaps insgesamt						<u>\$ 119,429,656</u>

- (a) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für offene OTC-Derivate zu dienen.
- (b) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (c) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 30. August 2024.
- (d) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 30. August 2024.
- (e) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (f) Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (g) Kredit, bei dem bis zur Endfälligkeit nur Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (h) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (i) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (j) 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:

ABS	–	Asset-Backed Securities
CBT	–	Chicago Board of Trade
CDX-NAHY	–	North American High Yield Credit Default Swap Index
CJSC	–	Closed Joint Stock Company
CLO	–	Collateralized Loan Obligations
CMBS	–	Commercial Mortgage-Backed Securities
INTRCONX	–	Intercontinental Exchange
JSC	–	Joint Stock Company
LCH	–	London Clearing House
REIT	–	Real Estate Investment Trust
REMICS	–	Real Estate Mortgage Investment Conduits
SOFR	–	Secured Overnight Financing Rate

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Agps Bondco PLC	6.00%	08/05/2025	EUR 6,100	€ 1,904,619	0.2%
Constellium SE	3.13%	07/15/2029	4,860	4,547,275	0.4
Constellium SE	5.38%	08/15/2032	1,850	1,866,109	0.2
Fiber Bidco SpA	6.13%	06/15/2031	1,109	1,103,260	0.1
Fiber Bidco SpA(a)	7.70%	01/15/2030	2,300	2,312,020	0.2
Guala Closures SpA(a)	7.72%	06/29/2029	3,180	3,191,350	0.3
INEOS Finance PLC	6.38%	04/15/2029	6,500	6,731,364	0.5
INEOS Quattro Finance 2 PLC	8.50%	03/15/2029	4,006	4,256,386	0.3
Italmatch Chemicals SpA	10.00%	02/06/2028	4,478	4,760,364	0.4
Itelyum Regeneration SpA	4.63%	10/01/2026	2,720	2,675,985	0.2
Monitchem HoldCo 3 SA	8.75%	05/01/2028	2,970	2,974,889	0.2
Monitchem HoldCo 3 SA(a)	8.97%	05/01/2028	2,540	2,539,447	0.2
Olympus Water US Holding Corp.	9.63%	11/15/2028	2,447	2,623,608	0.2
Reno de Medici SpA(a)	8.72%	04/15/2029	4,385	4,281,270	0.3
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	4.38%	11/01/2026	3,900	3,879,106	0.3
SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC	9.50%	07/15/2028	595	644,508	0.1
SNF Group SACA	2.63%	02/01/2029	2,480	2,324,082	0.2
Synthomer PLC	7.38%	05/02/2029	2,052	2,168,083	0.2
WEPA Hygieneprodukte GmbH	5.63%	01/15/2031	2,323	2,360,410	0.2
				<u>57,144,135</u>	<u>4.7</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Crown European Holdings SACA	4.50%	01/15/2030	1,280	1,305,984	0.1
Derichebourg SA	2.25%	07/15/2028	1,800	1,678,265	0.1
EMRLD Borrower LP/Emerald Co-Issuer, Inc.	6.38%	12/15/2030	2,522	2,635,349	0.2
IMA Industria Macchine Automatiche SpA	3.75%	01/15/2028	1,860	1,792,781	0.1
IMA Industria Macchine Automatiche SpA(a)	7.44%	04/15/2029	4,207	4,243,104	0.3
Paprec Holding SA	7.25%	11/17/2029	3,043	3,213,704	0.3
Project Grand UK PLC	9.00%	06/01/2029	4,018	4,138,084	0.3
TK Elevator Midco GmbH	4.38%	07/15/2027	2,608	2,566,371	0.2
				<u>21,573,642</u>	<u>1.6</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Banjay Entertainment SAS	7.00%	05/01/2029	1,243	1,309,306	0.1
Virgin Media Finance PLC	3.75%	07/15/2030	1,520	1,345,832	0.1
Ziggo Bond Co. BV	3.38%	02/28/2030	5,350	4,747,098	0.4
				<u>7,402,236</u>	<u>0.6</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Altice Finco SA	4.75%	01/15/2028	2,047	1,383,593	0.1
Altice France Holding SA	8.00%	05/15/2027	1,500	539,749	0.0
Altice France SA	3.38%	01/15/2028	2,770	1,975,156	0.2
Altice France SA	11.50%	02/01/2027	2,200	1,792,096	0.1
eircom Finance DAC	5.75%	12/15/2029	2,500	2,567,740	0.2
Iliad Holding SASU	5.13%	10/15/2026	669	675,520	0.1
Kaixo Bondco Telecom SA	5.13%	09/30/2029	1,950	1,955,188	0.2
Lorca Telecom Bondco SA	4.00%	09/18/2027	775	770,429	0.1
Optics Bidco SpA	6.88%	02/15/2028	958	1,039,398	0.1
Optics Bidco SpA	7.88%	07/31/2028	3,451	3,897,545	0.3
PLT VII Finance SARL(a)	7.24%	06/15/2031	3,600	3,591,855	0.3
Telefonica Europe BV(b)	6.14%	02/03/2030	2,400	2,547,029	0.2
United Group BV	6.75%	02/15/2031	444	467,416	0.0
United Group BV(a)	7.79%	02/15/2031	1,331	1,335,287	0.1
Vmed O2 UK Financing I PLC	4.00%	01/31/2029	GBP 8,900	9,395,635	0.7
Vodafone Group PLC	4.88%	10/03/2078	5,925	6,960,296	0.6
Vodafone Group PLC, Series E	6.50%	08/30/2084	EUR 1,655	1,804,523	0.1
				<u>42,698,455</u>	<u>3.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Aston Martin Capital Holdings Ltd.	10.38%	03/31/2029	GBP 1,440	1,720,247	0.1
Dana Financing Luxembourg SARL	3.00%	07/15/2029	EUR 1,760	1,594,247	0.1
Dana Financing Luxembourg SARL	8.50%	07/15/2031	1,871	2,020,873	0.2
Goodyear Europe BV	2.75%	08/15/2028	3,000	2,746,916	0.2
IHO Verwaltungs GmbH(c)	8.75%	05/15/2028	3,125	3,336,020	0.3
ZF Europe Finance BV	3.00%	10/23/2029	900	832,238	0.1
ZF Europe Finance BV, Series E	4.75%	01/31/2029	1,300	1,305,380	0.1
ZF Europe Finance BV, Series E	6.13%	03/13/2029	1,100	1,159,412	0.1
ZF Finance GmbH, Series E	3.75%	09/21/2028	2,600	2,515,120	0.2
				<u>17,230,453</u>	<u>1.4</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	5.75%	01/15/2030	EUR 2,014	€ 2,112,444	0.2%
Deuce Finco PLC(a)	8.47%	06/15/2027	5,630	5,660,987	0.4
Loarre Investments SARL	6.50%	05/15/2029	4,160	4,242,529	0.3
Motion Finco SARL	7.38%	06/15/2030	3,770	3,798,443	0.3
Pinnacle Bidco PLC.	10.00%	10/11/2028	GBP 1,409	1,794,666	0.1
				<u>17,609,069</u>	<u>1.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
888 Acquisitions Ltd.	10.75%	05/15/2030	3,062	3,693,369	0.3
Accor SA(b).	7.25%	01/11/2029	EUR 2,500	2,747,841	0.2
Assemblin Caverion Group AB	6.25%	07/01/2030	1,633	1,668,305	0.1
Assemblin Caverion Group AB(a).	7.20%	07/01/2031	1,840	1,839,401	0.1
Cirsa Finance International SARL	6.50%	03/15/2029	1,711	1,771,542	0.1
Cirsa Finance International SARL	10.38%	11/30/2027	1,503	1,595,019	0.1
Kier Group PLC.	9.00%	02/15/2029	GBP 3,002	3,764,549	0.3
Lottomatica SpA/Roma	5.38%	06/01/2030	EUR 1,400	1,426,664	0.1
Lottomatica SpA/Roma	7.13%	06/01/2028	1,750	1,842,023	0.1
Lottomatica SpA/Roma(a)	7.51%	12/15/2030	300	302,320	0.0
Maison Finco PLC.	6.00%	10/31/2027	GBP 4,693	5,295,085	0.4
Miller Homes Group Finco PLC	7.00%	05/15/2029	1,870	2,135,924	0.2
Miller Homes Group Finco PLC(a).	8.79%	05/15/2028	EUR 3,066	3,087,129	0.2
Minor Hotels Europe & Americas SA	4.00%	07/02/2026	3,987	3,986,220	0.3
ONE Hotels GmbH	7.75%	04/02/2031	2,500	2,624,128	0.2
Playtech PLC	5.88%	06/28/2028	3,940	4,024,671	0.3
Sani/Ikos Financial Holdings 1 SARL	7.25%	07/31/2030	2,260	2,273,916	0.2
Standard Industries, Inc./NY	2.25%	11/21/2026	1,900	1,814,260	0.1
TVL Finance PLC(a)	7.45%	06/30/2030	1,800	1,795,713	0.1
TVL Finance PLC	10.25%	04/28/2028	GBP 1,000	1,225,114	0.1
				<u>48,913,193</u>	<u>3.5</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
Bertrand Franchise Finance SAS.	6.50%	07/18/2030	EUR 250	256,294	0.0
Bertrand Franchise Finance SAS(a).	7.49%	07/18/2030	2,203	2,214,156	0.2
Punch Finance PLC	6.13%	06/30/2026	GBP 2,800	3,293,913	0.3
				<u>5,764,363</u>	<u>0.5</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Afflelou SAS	6.00%	07/25/2029	EUR 839	860,862	0.1
B&M European Value Retail SA	4.00%	11/15/2028	GBP 1,069	1,182,959	0.1
B&M European Value Retail SA	8.13%	11/15/2030	2,848	3,611,393	0.3
Birkenstock Financing SARL	5.25%	04/30/2029	EUR 2,840	2,860,290	0.2
CD&R Firefly Bidco PLC	8.63%	04/30/2029	GBP 3,098	3,725,312	0.3
CT Investment GmbH	6.38%	04/15/2030	EUR 1,230	1,257,675	0.1
Fnac Darty SA	6.00%	04/01/2029	1,800	1,877,645	0.2
Goldstory SAS	6.75%	02/01/2030	2,050	2,084,824	0.2
Shiba Bidco SpA	4.50%	10/31/2028	3,529	3,417,250	0.3
				<u>20,878,210</u>	<u>1.8</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Bellis Acquisition Co. PLC	8.13%	05/14/2030	GBP 5,072	5,860,672	0.5
CAB SELAS	3.38%	02/01/2028	EUR 4,080	3,775,660	0.3
Cerba Healthcare SACA	3.50%	05/31/2028	3,800	3,296,408	0.3
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	7.50%	05/15/2030	4,690	4,892,035	0.4
Ephios Subco 3 SARL	7.88%	01/31/2031	3,004	3,215,276	0.3
Flos B&b Italia SpA.	10.00%	11/15/2028	1,600	1,703,325	0.1
Grifols SA	3.88%	10/15/2028	5,357	5,020,799	0.4
Gruenthal GmbH	6.75%	05/15/2030	4,080	4,317,219	0.3
Iceland Bondco PLC(a)	9.04%	12/15/2027	1,649	1,677,098	0.1
Iceland Bondco PLC	10.88%	12/15/2027	GBP 828	1,056,790	0.1
Lion/Polaris Lux 4 SA(a).	7.33%	07/01/2029	EUR 1,281	1,288,568	0.1
Market Bidco Finco PLC	5.50%	11/04/2027	GBP 1,640	1,821,179	0.1
Neopharmed Gentili SpA.	7.13%	04/08/2030	EUR 1,859	1,909,813	0.2
Neopharmed Gentili SpA(a)	7.94%	04/08/2030	1,150	1,160,419	0.1
Nidda Healthcare Holding GmbH	7.00%	02/21/2030	2,500	2,564,178	0.2
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV.	2.88%	04/30/2028	1,890	1,799,534	0.1
Picard Groupe SAS	6.38%	07/01/2029	1,324	1,367,428	0.1
Primo Water Holdings, Inc.	3.88%	10/31/2028	2,770	2,724,626	0.2
Rossini SARL	6.75%	12/31/2029	2,205	2,286,392	0.2
Rossini SARL(a)	7.55%	12/31/2029	887	895,100	0.1
Versuni Group BV	3.13%	06/15/2028	1,300	1,191,814	0.1
				<u>53,824,333</u>	<u>4.3</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Azelis Finance NV.	5.75%	03/15/2028	3,240	3,340,556	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettovermögen %
Belden, Inc.	3.38%	07/15/2027	EUR 1,960	€ 1,943,873	0.2%
Manuchar Group SARL.	7.25%	06/30/2027	1,800	1,741,993	0.1
Multiversity SpA(a)	7.91%	10/30/2028	3,450	3,463,350	0.3
Nexans SA	4.25%	03/11/2030	900	915,808	0.1
Pachelbel Bidco SpA	7.13%	05/17/2031	1,366	1,434,275	0.1
ProGroup AG	5.38%	04/15/2031	1,768	1,721,406	0.1
Rexel SA	5.25%	09/15/2030	1,600	1,668,068	0.1
SIG PLC.	5.25%	11/30/2026	6,954	6,538,521	0.5
Travis Perkins PLC	3.75%	02/17/2026	GBP 2,950	3,353,995	0.3
				<u>26,121,845</u>	<u>2.1</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL.	4.88%	06/01/2028	3,364	3,654,445	0.3
APCOA Holdings GmbH.	4.63%	01/15/2027	EUR 4,165	4,062,888	0.3
Elior Group SA	3.75%	07/15/2026	1,972	1,936,764	0.2
Engineering - Ingegneria Informatica - SpA	11.13%	05/15/2028	1,710	1,728,654	0.1
House of HR Group BV.	9.00%	11/03/2029	2,000	2,006,723	0.2
Q-Park Holding I BV.	5.13%	03/01/2029	2,344	2,399,670	0.2
Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH.	6.00%	07/30/2026	2,289	2,289,097	0.2
Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH.	5.38%	07/15/2029	2,695	2,750,872	0.2
TUI AG	5.88%	03/15/2029	800	813,545	0.1
Verisure Holding AB	5.50%	05/15/2030	1,327	1,366,810	0.1
				<u>23,009,468</u>	<u>1.9</u>
TECHNOLOGIE					
BE Semiconductor Industries NV	4.50%	07/15/2031	6,321	6,449,449	0.5
Cedacri Mergeco SpA(a)	8.17%	05/15/2028	6,171	6,156,155	0.5
iliad SA.	5.38%	02/15/2029	1,000	1,042,806	0.1
iliad SA.	5.63%	02/15/2030	1,200	1,255,986	0.1
IPD 3 BV(a)	7.09%	06/15/2031	1,347	1,344,560	0.1
IPD 3 BV.	8.00%	06/15/2028	3,756	3,992,908	0.3
TeamSystem SpA(a)	7.13%	07/31/2031	800	799,897	0.1
TeamSystem SpA(a)	7.44%	02/15/2028	3,040	3,054,687	0.2
				<u>24,096,448</u>	<u>1.9</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Avis Budget Finance PLC	7.00%	02/28/2029	3,000	2,984,565	0.2
Avis Budget Finance PLC	7.25%	07/31/2030	1,097	1,091,515	0.1
BCP V Modular Services Finance II PLC.	6.13%	11/30/2028	GBP 2,750	3,060,855	0.2
BCP V Modular Services Finance PLC.	6.75%	11/30/2029	EUR 2,664	2,301,352	0.2
Boels Topholding BV.	5.75%	05/15/2030	2,322	2,384,256	0.2
Boels Topholding BV.	6.25%	02/15/2029	2,250	2,337,188	0.2
Gatwick Airport Finance PLC.	4.38%	04/07/2026	GBP 5,600	6,460,108	0.5
Heathrow Finance PLC	6.63%	03/01/2031	2,500	2,948,773	0.2
Kapla Holding SAS(a)	7.22%	07/31/2030	EUR 2,942	2,946,577	0.2
Loxam SAS	5.75%	07/15/2027	2,020	2,014,168	0.2
Loxam SAS	6.38%	05/31/2029	1,105	1,159,104	0.1
Loxam SAS, Series E.	6.38%	05/15/2028	2,280	2,376,837	0.2
				<u>32,065,298</u>	<u>2.5</u>
				<u>398,331,148</u>	<u>31.5</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Abanca Corp. Bancaria SA, Series E.	8.38%	09/23/2033	1,300	1,460,240	0.1
AIB Group PLC(b)	7.13%	10/30/2029	2,066	2,131,208	0.2
Banco de Sabadell SA(b)	5.00%	05/19/2027	1,400	1,338,528	0.1
Banco de Sabadell SA, Series E	5.63%	05/06/2026	2,800	2,894,297	0.2
Bank of Ireland Group PLC(b)	7.50%	05/19/2025	2,854	2,904,719	0.2
Deutsche Bank AG.	8.13%	04/30/2173	400	411,000	0.0
Intesa Sanpaolo SpA(b)	7.00%	05/20/2032	2,340	2,389,678	0.2
Virgin Money UK PLC(b)	8.25%	06/17/2027	GBP 1,344	1,628,443	0.1
				<u>15,158,113</u>	<u>1.1</u>
MAKLER					
Kane Bidco Ltd.	6.50%	02/15/2027	1,953	2,271,590	0.2
Sherwood Financing PLC	4.50%	11/15/2026	EUR 1,478	1,373,909	0.1
Sherwood Financing PLC	6.00%	11/15/2026	GBP 2,730	2,921,810	0.2
				<u>6,567,309</u>	<u>0.5</u>
VERSICHERUNGEN					
Ardonagh Finco Ltd.	6.88%	02/15/2031	EUR 3,640	3,662,160	0.3
SONSTIGE FINANZWERTE					
Encore Capital Group, Inc.	5.38%	02/15/2026	GBP 4,100	4,832,409	0.4

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
REITs					
Aedas Homes Opco SL	4.00%	08/15/2026	EUR 3,250	€ 3,242,377	0.3%
Agps Bondco PLC	5.00%	01/14/2029	2,600	807,789	0.1
Emeria SASU	7.75%	03/31/2028	4,300	4,035,065	0.3
Vivion Investments SARL, Series E(c)	7.90%	08/31/2028	39	35,897	0.0
Vivion Investments SARL, Series E(c)	7.90%	02/28/2029	10	9,335	0.0
				<u>8,130,463</u>	<u>0.7</u>
				<u>38,350,454</u>	<u>3.0</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ERDGAS					
UGI International LLC	2.50%	12/01/2029	3,350	3,032,944	0.2
				<u>439,714,546</u>	<u>34.7</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Anglo American Capital PLC, Series E	5.00%	03/15/2031	5,500	5,858,172	0.5
Celanese US Holdings LLC	4.78%	07/19/2026	5,150	5,253,193	0.4
Syensqo SA(b)	2.50%	12/02/2025	1,300	1,264,250	0.1
				<u>12,375,615</u>	<u>1.0</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Pinewood Finco PLC	3.25%	09/30/2025	GBP 2,500	2,904,424	0.2
Pinewood Finco PLC	3.63%	11/15/2027	2,170	2,424,627	0.2
Pinewood Finco PLC	6.00%	03/27/2030	2,000	2,372,921	0.2
Time Warner Cable LLC	5.75%	06/02/2031	1,635	1,872,925	0.1
Warnermedia Holdings, Inc.	4.30%	01/17/2030	EUR 948	938,663	0.1
				<u>10,513,560</u>	<u>0.8</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
AT&T, Inc.	3.95%	04/30/2031	2,495	2,576,032	0.2
CK Hutchison Group Telecom Finance SA	1.50%	10/17/2031	1,432	1,238,903	0.1
Orange SA, Series E(b)	5.38%	01/18/2030	7,100	7,508,250	0.6
				<u>11,323,185</u>	<u>0.9</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Aptiv PLC/Aptiv Global Financing Ltd.	4.25%	06/11/2036	3,040	3,042,084	0.2
Ford Motor Credit Co. LLC	6.13%	05/15/2028	2,182	2,344,661	0.2
Ford Motor Credit Co. LLC, Series E	5.13%	02/20/2029	3,300	3,438,788	0.3
General Motors Financial Co., Inc., Series E	4.00%	07/10/2030	1,772	1,792,616	0.1
General Motors Financial Co., Inc., Series E	4.50%	11/22/2027	2,332	2,411,594	0.2
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	5.13%	04/05/2026	2,403	2,458,467	0.2
RCI Banque SA	4.13%	04/04/2031	4,650	4,705,652	0.4
Schaeffler AG, Series E	4.50%	03/28/2030	1,500	1,513,413	0.1
Schaeffler AG, Series E	4.75%	08/14/2029	500	511,352	0.0
Toyota Motor Finance Netherlands BV, Series E	4.63%	06/08/2026	GBP 1,740	2,068,148	0.2
				<u>24,286,775</u>	<u>1.9</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
CPUK Finance Ltd.	5.88%	08/28/2027	646	773,483	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Berkeley Group PLC (The)	2.50%	08/11/2031	2,000	1,888,090	0.1
Flutter Treasury Designated Activity Co.	5.00%	04/29/2029	EUR 4,105	4,204,006	0.3
				<u>6,092,096</u>	<u>0.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
McDonald's Corp., Series G	3.88%	02/20/2031	1,345	1,384,965	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Marks & Spencer PLC	4.50%	07/10/2027	GBP 5,100	5,921,240	0.5
PVH Corp.	4.13%	07/16/2029	EUR 2,300	2,325,103	0.2
Tapestry, Inc.	5.88%	11/27/2031	2,933	3,076,152	0.2
VF Corp., Series E	4.25%	03/07/2029	4,307	4,222,611	0.3
				<u>15,545,106</u>	<u>1.2</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
General Mills, Inc.	3.65%	10/23/2030	2,154	2,182,466	0.2
ENERGIE					
BP Capital Markets PLC(b)	3.63%	03/22/2029	3,671	3,551,890	0.3
BP Capital Markets PLC(b)	4.25%	03/22/2027	GBP 1,333	1,530,711	0.1
Eni SpA, Series NC9(b)	3.38%	07/13/2029	EUR 3,787	3,604,902	0.3
Repsol International Finance BV(b)	2.50%	12/22/2026	3,572	3,429,454	0.3
TotalEnergies SE(b)	2.00%	06/04/2030	4,108	3,651,250	0.3
TotalEnergies SE, Series NC7(b)	1.63%	10/25/2027	2,100	1,944,271	0.2
				<u>17,712,478</u>	<u>1.5</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
LKQ Dutch Bond BV	4.13%	03/13/2031	EUR 4,627	€ 4,683,657	0.4%
DIENSTLEISTUNGEN					
Booking Holdings, Inc.	3.50%	03/01/2029	1,612	1,634,340	0.1
Booking Holdings, Inc.	4.50%	11/15/2031	1,741	1,864,467	0.1
Boost Newco Borrower LLC/GTCR W Dutch Finance Sub BV	8.50%	01/15/2031	GBP 1,817	2,331,305	0.2
Global Payments, Inc.	4.88%	03/17/2031	EUR 2,916	3,071,380	0.2
				8,901,492	0.6
TECHNOLOGIE					
Fiserv, Inc.	4.50%	05/24/2031	5,550	5,833,155	0.5
Infinion Technologies AG(b)	3.63%	01/01/2028	4,500	4,400,983	0.3
				10,234,138	0.8
				126,009,016	9.9
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
ABN AMRO Bank NV(b)	4.75%	09/22/2027	2,200	2,109,250	0.2
AIB Group PLC, Series E	4.63%	07/23/2029	2,718	2,828,724	0.2
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series E	8.25%	11/30/2033	GBP 1,500	1,923,520	0.1
Banco BPM SpA, Series E	6.00%	06/14/2028	EUR 2,420	2,563,674	0.2
Banco Santander SA(b)	7.00%	11/20/2029	1,800	1,854,460	0.1
Banco Santander SA, Series E	5.00%	04/22/2034	3,800	3,924,649	0.3
Bankinter SA	5.00%	06/25/2034	2,300	2,341,326	0.2
Banque Federative du Credit Mutuel SA	3.88%	06/16/2032	2,800	2,789,239	0.2
Banque Federative du Credit Mutuel SA, Series E	4.38%	05/02/2030	1,400	1,451,945	0.1
Barclays PLC	4.35%	05/08/2035	533	546,062	0.0
Barclays PLC	4.51%	01/31/2033	1,991	2,063,838	0.2
Barclays PLC(b)	6.38%	12/15/2025	GBP 4,310	5,069,096	0.4
Barclays PLC, Series E	4.92%	08/08/2030	EUR 1,802	1,900,148	0.1
Barclays PLC, Series E	8.41%	11/14/2032	GBP 450	568,634	0.0
BNP Paribas SA(b)	6.88%	12/06/2029	EUR 6,200	6,489,490	0.5
CaixaBank SA(b)	5.88%	10/09/2027	4,600	4,598,803	0.4
CaixaBank SA, Series E	6.25%	02/23/2033	2,000	2,130,133	0.2
Citigroup, Inc.	3.75%	05/14/2032	4,765	4,784,632	0.4
Commerzbank AG, Series E	4.00%	07/16/2032	1,200	1,206,193	0.1
Commerzbank AG, Series E	5.13%	01/18/2030	500	529,301	0.0
Commerzbank AG, Series E	6.50%	12/06/2032	4,300	4,592,060	0.4
Commerzbank AG, Series E	8.63%	02/28/2033	GBP 1,000	1,282,072	0.1
Cooperatieve Rabobank UA(b)	4.38%	06/29/2027	EUR 7,400	7,191,881	0.6
Danske Bank A/S, Series E	4.50%	11/09/2028	3,301	3,410,508	0.3
Deutsche Bank AG	3.25%	05/24/2028	2,000	1,987,332	0.2
Deutsche Bank AG	5.00%	09/05/2030	2,300	2,411,293	0.2
Deutsche Bank AG, Series E	1.75%	11/19/2030	1,400	1,261,048	0.1
Erste Group Bank AG(b)	4.25%	10/15/2027	7,000	6,504,321	0.5
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	7.13%	08/07/2025	GBP 7,565	9,148,552	0.7
HSBC Holdings PLC	6.36%	11/16/2032	EUR 5,791	6,181,647	0.5
HSBC Holdings PLC, Series E(b)	4.75%	07/04/2029	6,748	6,476,238	0.5
ING Groep NV	4.13%	08/24/2033	4,400	4,416,250	0.3
ING Groep NV, Series E	4.38%	08/15/2034	2,000	2,020,598	0.2
Intesa Sanpaolo SpA, Series E	2.50%	01/15/2030	GBP 1,316	1,370,005	0.1
JPMorgan Chase & Co., Series E	1.64%	05/18/2028	EUR 2,300	2,214,016	0.2
JPMorgan Chase & Co., Series E	3.67%	06/06/2028	1,910	1,934,541	0.2
JPMorgan Chase & Co., Series E	3.76%	03/21/2034	1,645	1,662,372	0.1
KBC Group NV(b)	4.25%	10/24/2025	6,000	5,893,858	0.5
KBC Group NV, Series E	6.15%	03/19/2034	GBP 1,300	1,567,870	0.1
Lloyds Banking Group PLC(b)	7.88%	06/27/2029	1,746	2,120,707	0.2
Lloyds Banking Group PLC, Series E	4.38%	04/05/2034	EUR 1,000	1,012,480	0.1
Lloyds Banking Group PLC, Series E	4.75%	09/21/2031	3,967	4,208,100	0.3
Morgan Stanley	3.79%	03/21/2030	1,989	2,018,700	0.2
Morgan Stanley, Series G	5.15%	01/25/2034	2,791	3,072,216	0.2
Nationwide Building Society(b)	5.75%	06/20/2027	GBP 4,442	5,072,936	0.4
Nationwide Building Society	6.18%	12/07/2027	1,027	1,249,364	0.1
NatWest Group PLC, Series E	4.70%	03/14/2028	EUR 2,452	2,531,226	0.2
NatWest Group PLC, Series E	7.42%	06/06/2033	GBP 779	971,573	0.1
NatWest Markets PLC, Series E	6.38%	11/08/2027	2,475	3,071,333	0.2
Skandinaviska Enskilda Banken AB, Series E	0.75%	08/09/2027	EUR 3,784	3,530,453	0.3
Svenska Handelsbanken AB, Series E	5.00%	08/16/2034	980	1,028,641	0.1
Swedbank AB, Series G	1.30%	02/17/2027	2,040	1,948,191	0.2
Swedbank AB, Series G	3.63%	08/23/2032	2,200	2,192,379	0.2
UBS Group AG	4.13%	06/09/2033	5,139	5,264,350	0.4

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
UniCredit SpA, Series E	3.88%	06/11/2028	EUR 1,220	€ 1,233,617	0.1%
UniCredit SpA, Series E	4.30%	01/23/2031	2,900	2,977,241	0.2
US Bancorp	4.01%	05/21/2032	2,526	2,569,859	0.2
Virgin Money UK PLC	4.00%	03/18/2028	1,513	1,530,825	0.1
Virgin Money UK PLC, Series G	7.63%	08/23/2029	GBP 300	387,362	0.0
				<u>171,191,132</u>	<u>13.5</u>
VERSICHERUNGEN					
Allianz SE, Series E	4.25%	07/05/2052	EUR 11,600	11,720,686	0.9
ASR Nederland NV	3.38%	05/02/2049	13,599	13,048,763	1.0
CNP Assurances SACA(b)	4.75%	06/27/2028	12,000	11,763,655	0.9
Credit Agricole Assurances SA(b)	4.25%	01/13/2025	500	499,449	0.0
Credit Agricole Assurances SA	4.75%	09/27/2048	5,200	5,286,648	0.4
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co., Series E	1.88%	09/17/2050	2,232	2,001,511	0.2
				<u>44,320,712</u>	<u>3.4</u>
REITs					
American Tower Corp.	4.63%	05/16/2031	4,574	4,828,359	0.4
Digital Intrepid Holding BV	0.63%	07/15/2031	2,550	2,055,790	0.2
Digital Stout Holding LLC	3.75%	10/17/2030	GBP 4,150	4,528,239	0.4
Summit Properties Ltd.	2.00%	01/31/2025	EUR 3,052	2,977,847	0.2
Unibail-Rodamco-Westfield SE, Series E	4.13%	12/11/2030	2,200	2,251,262	0.2
Westfield America Management Ltd.	2.63%	03/30/2029	GBP 1,972	2,073,960	0.2
				<u>18,715,457</u>	<u>1.6</u>
				<u>234,227,301</u>	<u>18.5</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Electricite de France SA, Series E	4.13%	06/17/2031	EUR 3,100	3,181,511	0.2
Electricite de France SA, Series E	4.25%	01/25/2032	600	622,601	0.0
Enel SpA, Series E(b)	6.38%	04/16/2028	3,080	3,282,170	0.3
TenneT Holding BV(b)	4.88%	12/21/2031	1,762	1,773,013	0.1
Vattenfall AB	3.00%	03/19/2077	800	772,749	0.1
Vattenfall AB	6.88%	08/17/2083	GBP 1,200	1,458,387	0.1
				<u>11,090,431</u>	<u>0.8</u>
ERDGAS					
National Grid North America, Inc., Series E	4.15%	09/12/2027	EUR 1,899	1,945,124	0.2
National Grid North America, Inc., Series E	4.67%	09/12/2033	3,260	3,444,709	0.3
				<u>5,389,833</u>	<u>0.5</u>
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE					
Anglian Water Osprey Financing PLC, Series E	2.00%	07/31/2028	GBP 1,940	1,797,656	0.1
Suez SACA, Series E	5.00%	11/03/2032	EUR 1,800	1,950,059	0.2
Veolia Environnement SA(b)	2.25%	01/20/2026	1,300	1,261,000	0.1
Veolia Environnement SA(b)	2.50%	01/20/2029	1,300	1,198,102	0.1
Veolia Environnement SA(b)	5.99%	11/22/2028	900	950,675	0.1
				<u>7,157,492</u>	<u>0.6</u>
				<u>23,637,756</u>	<u>1.9</u>
				<u>383,874,073</u>	<u>30.3</u>
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
FINNLAND					
Finland Government Bond, Series 15Y	4.00%	07/04/2025	16,638	16,775,958	1.3
FRANKREICH					
French Republic Government Bond OAT, Series OAT	5.75%	10/25/2032	23,791	28,766,425	2.3
DEUTSCHLAND					
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	6.25%	01/04/2030	65,565	78,851,431	6.2
IRLAND					
Ireland Government Bond	5.40%	03/13/2025	12,635	12,771,205	1.0
ITALIEN					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series 30Y	4.50%	10/01/2053	5,141	5,327,315	0.4
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series 31Y	6.00%	05/01/2031	35,618	41,472,703	3.3
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series 32Y	5.00%	08/01/2039	10,460	11,644,281	0.9
				<u>58,444,299</u>	<u>4.6</u>
SPANIEN					
Spain Government Bond	4.20%	01/31/2037	3,202	3,510,822	0.3
Spain Government Bond	5.15%	10/31/2044	12,693	15,524,759	1.2
Spain Government Bond	5.75%	07/30/2032	41,317	49,673,171	3.9
				<u>68,708,752</u>	<u>5.4</u>
VEREINIGTES KÖNIGREICH					
United Kingdom Gilt	4.38%	07/31/2054	GBP 15,737	18,245,663	1.5
				<u>282,563,733</u>	<u>22.3</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
GEDECKTE ANLEIHEN					
Banco de Sabadell SA, Series DMTN	3.50%	08/28/2026	EUR 3,400	€ 3,437,596	0.3%
Bank of Montreal	3.38%	07/04/2026	1,155	1,165,665	0.1
BNP Paribas Home Loan SFH SA, Series E	3.00%	01/31/2030	2,000	2,019,867	0.2
BPCE SFH SA	3.25%	04/12/2028	5,600	5,688,832	0.5
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	2.75%	04/12/2028	5,600	5,593,720	0.4
Caisse Francaise de Financement Local	3.50%	03/16/2032	6,100	6,333,413	0.5
Caisse Francaise de Financement Local, Series E	3.00%	10/02/2028	3,100	3,125,273	0.2
Caisse Francaise de Financement Local, Series E	3.13%	11/16/2027	3,100	3,134,634	0.3
Canadian Imperial Bank of Commerce	0.01%	10/07/2026	5,680	5,361,526	0.4
Cie de Financement Foncier SA	3.13%	05/18/2027	4,200	4,236,914	0.3
Cie de Financement Foncier SA, Series E	3.63%	01/16/2029	1,400	1,449,278	0.1
Commonwealth Bank of Australia	3.77%	08/31/2027	1,695	1,742,485	0.1
Commonwealth Bank of Australia, Series E	0.75%	02/28/2028	3,800	3,545,107	0.3
Erste Group Bank AG, Series E	0.63%	01/18/2027	3,400	3,227,685	0.3
National Australia Bank Ltd., Series G	0.63%	03/16/2027	3,970	3,756,996	0.3
Nationwide Building Society, Series E	2.25%	06/25/2029	3,200	3,116,601	0.2
Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj, Series E	3.00%	02/20/2030	2,500	2,534,107	0.2
Santander UK PLC	1.13%	03/12/2027	3,575	3,426,993	0.3
Toronto-Dominion Bank (The), Series G	0.86%	03/24/2027	1,850	1,760,549	0.1
Westpac Banking Corp., Series E	0.01%	09/22/2028	740	660,438	0.1
				<u>65,317,679</u>	<u>5.2</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB SICAV I - Euro Corporate Bond Portfolio - Class Z			200,409	<u>20,157,108</u>	<u>1.6</u>
SUPRANATIONALE UNTERNEHMEN					
European Union, Series NGEU	3.38%	10/05/2054	EUR 19,017	<u>18,960,152</u>	<u>1.5</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KOMMUNIKATIONS MEDIEN					
RCS & RDS SA	3.25%	02/05/2028	2,700	<u>2,585,250</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Allwyn Entertainment Financing UK PLC	7.25%	04/30/2030	4,055	<u>4,299,010</u>	<u>0.3</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	7.88%	09/15/2031	2,080	<u>2,433,600</u>	<u>0.2</u>
				<u>9,317,860</u>	<u>0.7</u>
				<u>1,219,905,151</u>	<u>96.3</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Hellas Telecommunications Luxembourg III(d)	8.50%	10/15/2049	641	<u>0</u>	<u>0.0</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
CPUK Finance Ltd.	4.50%	08/28/2027	GBP 2,937	3,262,327	0.3
CPUK Finance Ltd.	7.88%	08/28/2029	1,500	<u>1,803,636</u>	<u>0.1</u>
				<u>5,065,963</u>	<u>0.4</u>
				<u>5,065,963</u>	<u>0.4</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO 3 DAC, Series 2022-3A, Class A(a)	4.61%	10/25/2034	EUR 3,700	<u>3,675,817</u>	<u>0.3</u>
STAMMAKTIE					
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
BREIT ANGELEGTER EINZELHANDEL					
K201640219 South Africa Ltd. - Class A(d)			18,654,746	<u>17</u>	<u>0.0</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
K201640219 South Africa Ltd.(d) (e)	0.00%	06/25/2023	ZAR 57	<u>0</u>	<u>0.0</u>
				<u>8,741,797</u>	<u>0.7</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten €1,250,425,696)				<u>€ 1,228,646,948</u>	<u>97.0%</u>
Termineinlagen					
BNP Paribas, Paris(f)	1.71 %	–		2,199	0.0
DNB, Oslo(f)	3.05 %	–		14,651	0.0
HSBC, Singapore(f)	2.11 %	–		36	0.0
Nordea, Oslo(f)	3.26 %	–		122	0.0

	Zinssatz	Datum	Wert (EUR)	Nettövermögen %
SMBC, London(f)	3.90 %	–	€ 269,203	0.0%
SMBC, London(f)	4.68 %	–	2,220,837	0.2
SMBC, Tokyo(f)	2.62 %	–	7,073,673	0.6
Termineinlagen insgesamt			<u>9,580,721</u>	<u>0.8</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			<u>28,347,112</u>	<u>2.2</u>
Nettövermögen			<u>€ 1,266,574,781</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Long					
Euro Buxl 30 Yr Bond Futures	09/06/2024	5	€ 651,400	€ 672,600	€ 21,200
Euro-BTP Futures	12/06/2024	297	35,323,010	35,289,540	(33,470)
Euro-Bund Futures	09/06/2024	1,047	137,287,200	140,203,770	2,916,570
Euro-OAT Futures	09/06/2024	196	24,301,250	24,709,720	408,470
Short					
Euro-BOBL Futures	12/06/2024	539	64,135,610	64,119,440	16,170
					<u>€ 3,328,940</u>
				Wertsteigerung	€ 3,362,410
				Wertminderung	€ (33,470)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 3,764	EUR 481	09/09/2024	€ 1,090
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 224	EUR 28	09/09/2024	(380)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 171	CNH 1,346	09/09/2024	434
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 4,004	CNH 31,376	09/09/2024	(3,402)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 24,579	HKD 213,616	09/09/2024	203,886
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 25,204	HKD 214,664	09/09/2024	(300,189)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 3,721	PLN 16,082	09/09/2024	33,669
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 3,784	PLN 16,201	09/09/2024	(1,705)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 8,789	SGD 12,763	09/09/2024	60,131
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 250,022	USD 279,034	09/09/2024	2,347,830
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 250,732	USD 274,159	09/09/2024	(2,771,856)
Brown Brothers Harriman & Co.+	HKD 213,030	EUR 25,016	09/09/2024	301,175
Brown Brothers Harriman & Co.+	HKD 1,837	EUR 212	09/09/2024	(1,257)
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 16,171	EUR 3,742	09/09/2024	(33,657)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 6,416	EUR 4,428	09/09/2024	(20,438)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 275,238	EUR 251,701	09/09/2024	2,764,195
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,538	EUR 2,281	09/09/2024	(14,892)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 150,231	EUR 91,177	09/23/2024	(775,656)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF 468	EUR 492	09/23/2024	(6,329)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 181,795	AUD 300,205	09/23/2024	1,953,766
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 83	AUD 136	09/23/2024	(202)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 990	CHF 939	09/23/2024	11,145
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 539	SGD 783	09/23/2024	4,045
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 465,350	USD 518,422	09/23/2024	3,232,798
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 426	EUR 294	09/23/2024	(1,586)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 0*	EUR 0*	09/23/2024	–
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 259,265	EUR 233,302	09/23/2024	(1,037,704)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH 183	EUR 23	09/30/2024	(335)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 3,551	CNH 28,193	09/30/2024	49,309
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 14,900	HKD 129,617	09/30/2024	136,400
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 254,160	USD 284,025	09/30/2024	2,477,519
Brown Brothers Harriman & Co.+	HKD 68	EUR 8	09/30/2024	(83)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 0*	EUR 0*	09/30/2024	–
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 560	EUR 504	09/30/2024	(2,649)
HSBC Bank USA	GBP 152,980	EUR 180,646	11/08/2024	(633,625)
				<u>€ 7,971,447</u>
			Wertsteigerung	€ 13,577,392
			Wertminderung	€ (5,605,945)

+ Zur Absicherung des Portfolios oder der Anteilklassen.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nomineller Betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Kaufkontrakte					
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	iTraxx-XOVER Series 41, 5 Year Index, 06/20/2029	06/20/2029	EUR 14,025	€ (1,217,129)	€ (22,751)

* Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

- (a) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 30. August 2024.
- (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) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (e) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (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 – Bundesobligation
- BTP – Buoni del Tesoro Poliennali
- CAB – Capital Appreciation Bond
- CLO – Collateralized Loan Obligations
- INTRCONX – Intercontinental Exchange
- OAT – Obligations Assimilables du Trésor
- REIT – Real Estate Investment Trust

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
STAATSANLEIHEN					
Abu Dhabi Government International Bond	3.13%	09/30/2049	USD 2,940	\$ 2,160,900	0.5%
Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029	6,840	6,279,975	1.3
Angolan Government International Bond	8.25%	05/09/2028	2,208	2,110,710	0.4
Argentine Republic Government International Bond	0.75%	07/09/2030	3,976	2,260,419	0.5
Argentine Republic Government International Bond	1.00%	07/09/2029	3,635	2,186,424	0.5
Argentine Republic Government International Bond	3.50%	07/09/2041	746	310,600	0.1
Argentine Republic Government International Bond	4.13%	07/09/2035	9,345	4,144,567	0.9
Argentine Republic Government International Bond	5.00%	01/09/2038	3,343	1,626,223	0.3
Bahrain Government International Bond	6.00%	09/19/2044	1,100	943,594	0.2
Brazilian Government International Bond	7.13%	05/13/2054	2,805	2,872,376	0.6
Chile Government International Bond	5.33%	01/05/2054	2,192	2,174,201	0.5
Colombia Government International Bond	3.13%	04/15/2031	2,884	2,357,670	0.5
Colombia Government International Bond	3.25%	04/22/2032	4,354	3,470,138	0.7
Colombia Government International Bond	4.13%	02/22/2042	1,502	1,029,696	0.2
Colombia Government International Bond	6.13%	01/18/2041	610	531,615	0.1
Colombia Government International Bond	7.50%	02/02/2034	3,105	3,201,255	0.7
Colombia Government International Bond	8.00%	04/20/2033	3,205	3,414,927	0.7
Colombia Government International Bond	8.00%	11/14/2035	679	720,419	0.2
Costa Rica Government International Bond	7.30%	11/13/2054	1,300	1,407,653	0.3
Dominican Republic International Bond	5.95%	01/25/2027	5,315	5,361,506	1.1
Dominican Republic International Bond	6.85%	01/27/2045	726	763,665	0.2
Dominican Republic International Bond	8.63%	04/20/2027	4,482	4,675,309	1.0
Ecuador Government International Bond	5.00%	07/31/2040	3,725	1,882,987	0.4
Ecuador Government International Bond	5.50%	07/31/2035	6,702	3,703,006	0.8
Ecuador Government International Bond	5.50%	07/31/2035	6,596	3,644,492	0.8
Egypt Government International Bond	3.88%	02/16/2026	1,049	989,010	0.2
Egypt Government International Bond	5.25%	10/06/2025	1,007	980,881	0.2
Egypt Government International Bond	5.88%	02/16/2031	1,195	966,456	0.2
Egypt Government International Bond	6.59%	02/21/2028	2,353	2,191,967	0.5
Egypt Government International Bond	7.05%	01/15/2032	2,826	2,360,593	0.5
Egypt Government International Bond	7.50%	01/31/2027	1,070	1,046,594	0.2
Egypt Government International Bond	7.50%	02/16/2061	511	352,750	0.1
Egypt Government International Bond	7.90%	02/21/2048	4,084	3,006,845	0.6
Egypt Government International Bond	8.70%	03/01/2049	1,880	1,469,916	0.3
Egypt Government International Bond	8.75%	09/30/2051	587	460,061	0.1
Egypt Government International Bond	8.88%	05/29/2050	1,226	974,287	0.2
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	2,277	2,133,264	0.4
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	775	536,928	0.1
El Salvador Government International Bond	7.63%	02/01/2041	170	125,375	0.0
El Salvador Government International Bond	8.63%	02/28/2029	4,579	4,288,233	0.9
Ghana Government International Bond(a)	7.63%	05/16/2029	2,108	1,092,207	0.2
Ghana Government International Bond(a)	7.88%	02/11/2035	906	476,221	0.1
Ghana Government International Bond(a)	8.95%	03/26/2051	3,427	1,806,680	0.4
Guatemala Government Bond	6.05%	08/06/2031	2,350	2,395,919	0.5
Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS	8.51%	01/14/2029	1,590	1,717,697	0.4
Hungary Government International Bond	2.13%	09/22/2031	1,224	1,007,964	0.2
Hungary Government International Bond	5.50%	06/16/2034	2,987	3,023,404	0.6
Hungary Government International Bond	6.75%	09/25/2052	3,586	4,038,732	0.8
Indonesia Government International Bond	4.30%	03/31/2052	403	357,411	0.1
Israel Government International Bond, Series 30Y	5.75%	03/12/2054	3,130	3,001,338	0.6
Ivory Coast Government International Bond	5.75%	12/31/2032	444	418,182	0.1
Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	6,375	5,827,148	1.2
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	4,045	4,016,766	0.8
Jamaica Government International Bond	7.88%	07/28/2045	1,132	1,368,656	0.3
Jordan Government International Bond	7.50%	01/13/2029	2,497	2,534,455	0.5
Jordan Government International Bond	7.75%	01/15/2028	2,340	2,395,271	0.5
Kazakhstan Government International Bond	6.50%	07/21/2045	5,460	6,434,269	1.3
Lebanon Government International Bond, Series 10Y(b)	6.00%	01/27/2023	1,360	85,000	0.0
Lebanon Government International Bond, Series E(b)	6.10%	10/04/2022	6,321	395,062	0.1
Lebanon Government International Bond, Series G(a)	1.00%	11/27/2026	1,719	107,437	0.0
Lebanon Government International Bond, Series G(a)	6.20%	02/26/2025	4,428	276,750	0.1
Lebanon Government International Bond, Series G(a)	6.85%	03/23/2027	4,936	308,500	0.1
Morocco Government International Bond	6.50%	09/08/2033	867	925,601	0.2
Nigeria Government International Bond	6.13%	09/28/2028	9,195	8,275,500	1.7
Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027	2,156	2,007,775	0.4
Nigeria Government International Bond	7.14%	02/23/2030	2,389	2,161,298	0.5
Nigeria Government International Bond	7.38%	09/28/2033	1,627	1,360,579	0.3
Nigeria Government International Bond	8.38%	03/24/2029	602	582,623	0.1
Oman Government International Bond	6.75%	01/17/2048	382	414,351	0.1
Oman Government International Bond	7.00%	01/25/2051	200	223,437	0.0
Oman Government International Bond	7.38%	10/28/2032	2,215	2,519,563	0.5

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Pakistan Government International Bond	8.88%	04/08/2051	USD 4,150	\$ 3,107,313	0.6%
Panama Government International Bond	3.87%	07/23/2060	3,435	2,096,415	0.4
Panama Government International Bond	6.85%	03/28/2054	1,637	1,604,767	0.3
Panama Government International Bond	6.88%	01/31/2036	462	473,550	0.1
Panama Government International Bond	7.50%	03/01/2031	1,378	1,474,460	0.3
Panama Government International Bond	7.88%	03/01/2057	476	521,520	0.1
Panama Government International Bond	8.00%	03/01/2038	988	1,088,964	0.2
Paraguay Government International Bond	4.95%	04/28/2031	1,255	1,240,097	0.3
Paraguay Government International Bond	5.40%	03/30/2050	3,096	2,835,812	0.6
Peruvian Government International Bond	2.78%	12/01/2060	7,594	4,506,564	0.9
Philippine Government International Bond	3.20%	07/06/2046	3,307	2,459,581	0.5
Philippine Government International Bond	3.56%	09/29/2032	2,722	2,519,551	0.5
Philippine Government International Bond	4.20%	03/29/2047	1,850	1,610,078	0.3
Qatar Government International Bond	5.10%	04/23/2048	385	392,219	0.1
Republic of Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027	990	948,544	0.2
Republic of Kenya Government International Bond	8.00%	05/22/2032	3,435	3,051,791	0.6
Republic of Poland Government International Bond	4.88%	10/04/2033	1,282	1,295,589	0.3
Republic of Poland Government International Bond	5.50%	04/04/2053	887	906,035	0.2
Republic of South Africa Government International Bond	4.85%	09/30/2029	2,457	2,344,666	0.5
Republic of South Africa Government International Bond	5.38%	07/24/2044	1,602	1,294,464	0.3
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	265	213,325	0.0
Republic of South Africa Government International Bond	5.88%	04/20/2032	1,220	1,186,487	0.2
Republic of South Africa Government International Bond	6.30%	06/22/2048	2,185	1,892,756	0.4
Romanian Government International Bond	3.00%	02/14/2031	1,528	1,313,729	0.3
Romanian Government International Bond	3.63%	03/27/2032	2,928	2,572,980	0.5
Romanian Government International Bond	4.00%	02/14/2051	2,100	1,499,694	0.3
Romanian Government International Bond	5.88%	01/30/2029	1,048	1,066,340	0.2
Romanian Government International Bond	6.00%	05/25/2034	4,748	4,778,055	1.0
Saudi Government International Bond	3.45%	02/02/2061	2,640	1,831,500	0.4
Saudi Government International Bond	5.00%	04/17/2049	1,617	1,526,141	0.3
Saudi Government International Bond	5.25%	01/16/2050	2,098	2,055,384	0.4
Saudi Government International Bond	5.75%	01/16/2054	2,780	2,835,600	0.6
Senegal Government International Bond	4.75%	03/13/2028	1,659	1,726,692	0.4
Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	2,547	2,210,318	0.5
Senegal Government International Bond, Series 7Y	7.75%	06/10/2031	2,045	1,974,703	0.4
Serbia International Bond	6.50%	09/26/2033	4,474	4,667,501	1.0
Sri Lanka Government International Bond(a)	6.85%	11/03/2025	5,158	2,765,978	0.6
Sri Lanka Government International Bond(a)	7.55%	03/28/2030	1,932	1,019,130	0.2
Sri Lanka Government International Bond(a)	7.85%	03/14/2029	1,094	581,529	0.1
Trinidad & Tobago Government International Bond	6.40%	06/26/2034	1,885	1,925,528	0.4
Turkiye Government International Bond, Series 10Y	5.25%	03/13/2030	3,710	3,513,556	0.7
Turkiye Government International Bond, Series 10Y	5.88%	06/26/2031	1,521	1,437,345	0.3
Turkiye Government International Bond, Series 11Y	4.88%	10/09/2026	1,584	1,564,695	0.3
Turkiye Government International Bond, Series 11Y	6.13%	10/24/2028	2,164	2,170,763	0.5
Turkiye Government International Bond, Series 12Y	6.50%	09/20/2033	220	212,025	0.0
Turkiye Government International Bond, Series 30Y	5.75%	05/11/2047	2,006	1,584,740	0.3
Turkiye Government International Bond, Series 31Y	6.63%	02/17/2045	1,085	962,259	0.2
Ukraine Government International Bond	6.75%	06/20/2028	EUR 1,222	391,732	0.1
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2026	USD 5,724	1,900,368	0.4
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2028	5,103	1,581,930	0.3
Ukraine Government International Bond	8.99%	02/01/2026	1,750	621,250	0.1
Uruguay Government International Bond	4.98%	04/20/2055	1,478	1,422,961	0.3
Uruguay Government International Bond	5.10%	06/18/2050	1,379	1,368,388	0.3
Venezuela Government International Bond(a)	9.25%	09/15/2027	1,232	196,196	0.0
Zambia Government International Bond	0.50%	12/31/2053	1,098	543,956	0.1
Zambia Government International Bond	5.75%	06/30/2033	1,169	1,021,827	0.2
				242,582,624	50.3
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC	4.60%	11/02/2047	1,860	1,725,731	0.4
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	4.00%	08/11/2041	4,650	3,735,252	0.8
Banco Nacional de Panama	2.50%	08/11/2030	890	727,023	0.1
Bank Gospodarstwa Krajowego	5.38%	05/22/2033	957	979,662	0.2
Bank Gospodarstwa Krajowego	6.25%	07/09/2054	3,035	3,277,588	0.7
Bapco Energies BSC Closed	7.50%	10/25/2027	4,137	4,303,773	0.9
China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd.(c)	3.08%	12/09/2025	255	248,148	0.0
CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	5.13%	03/14/2028	400	403,656	0.1
Comision Federal de Electricidad	5.00%	09/29/2036	1,624	1,460,884	0.3
Comision Federal de Electricidad	6.26%	02/15/2052	355	320,387	0.1
Corp. Nacional del Cobre de Chile	5.95%	01/08/2034	5,904	6,125,400	1.3
DP World Ltd./United Arab Emirates	5.63%	09/25/2048	455	453,009	0.1
DP World Ltd./United Arab Emirates	6.85%	07/02/2037	2,400	2,718,000	0.6
DP World Salaam(c)	6.00%	10/01/2025	2,195	2,185,122	0.5

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA.....	4.70%	05/07/2050	USD 1,375	\$ 1,170,469	0.2%
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA.....	5.00%	01/25/2047	240	214,050	0.0
Empresa Nacional del Petroleo	4.50%	09/14/2047	3,175	2,511,235	0.5
Empresa Nacional del Petroleo	5.95%	07/30/2034	660	684,750	0.1
Eskom Holdings SOC Ltd.	7.13%	02/11/2025	1,115	1,115,348	0.2
Gaci First Investment Co.	4.88%	02/14/2035	1,977	1,945,181	0.4
Gaci First Investment Co.	5.38%	01/29/2054	2,425	2,256,579	0.5
Pertamina Persero PT.....	2.30%	02/09/2031	4,822	4,147,306	0.9
Pertamina Persero PT.....	6.00%	05/03/2042	220	229,418	0.0
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara.	5.25%	10/24/2042	460	430,965	0.1
Petroleos de Venezuela SA(a)	5.38%	04/12/2027	7,377	752,853	0.2
Petroleos de Venezuela SA(a)	5.50%	04/12/2037	4,197	427,842	0.1
Petroleos Mexicanos	6.35%	02/12/2048	6,980	4,607,638	1.0
Petroleos Mexicanos	6.50%	01/23/2029	10,465	9,604,908	2.0
Petroleos Mexicanos	6.88%	08/04/2026	2,713	2,674,014	0.6
Petroleos Mexicanos	7.69%	01/23/2050	1,351	1,002,712	0.2
Petroleos Mexicanos	8.75%	06/02/2029	2,560	2,538,240	0.5
Powerchina Roadbridge Group British Virgin Islands Ltd.(c).	3.08%	04/01/2026	3,365	3,264,050	0.7
QatarEnergy	3.13%	07/12/2041	2,339	1,847,810	0.4
QatarEnergy	3.30%	07/12/2051	8,127	6,032,266	1.3
Sinochem Offshore Capital Co., Ltd., Series E.....	2.38%	09/23/2031	760	641,220	0.1
Southern Gas Corridor CJSC.....	6.88%	03/24/2026	1,158	1,177,541	0.2
TC Ziraat Bankasi AS	8.00%	01/16/2029	3,429	3,544,729	0.7
Transnet SOC Ltd.	8.25%	02/06/2028	5,187	5,334,518	1.1
Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS.....	9.00%	01/28/2027	1,248	1,319,760	0.3
Ziraat Katilim Varlik Kiralama AS	9.38%	11/12/2026	1,350	1,441,260	0.3
				<u>89,580,297</u>	<u>18.7</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
Absa Group Ltd.(c)	6.38%	05/27/2026	638	625,042	0.1
Acu Petroleo Luxembourg SARM	7.50%	01/13/2032	843	833,538	0.2
Adani Electricity Mumbai Ltd.	3.95%	02/12/2030	680	610,300	0.1
Adani Green Energy Ltd.....	4.38%	09/08/2024	1,725	1,724,310	0.4
Adani Green Energy UP Ltd./Prayatna Developers Pvt. Ltd./ Parampujya Solar Energ	6.70%	03/12/2042	278	269,921	0.1
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	3.10%	02/02/2031	285	239,292	0.1
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	3.83%	02/02/2032	335	288,415	0.1
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	4.38%	07/03/2029	890	832,150	0.2
Adani Transmission Step-One Ltd.	4.25%	05/21/2036	657	572,077	0.1
Aegea Finance SARM	9.00%	01/20/2031	475	509,307	0.1
AES Andes SA.....	6.30%	03/15/2029	411	423,466	0.1
AES Andes SA.....	8.15%	06/10/2055	470	481,687	0.1
AES Panama Generation Holdings SRL	4.38%	05/31/2030	801	716,451	0.2
Akbank TAS	7.50%	01/20/2030	431	438,676	0.1
Alfa Desarrollo SpA.....	4.55%	09/27/2051	1,658	1,298,586	0.3
Aris Mining Corp.	6.88%	08/09/2026	1,000	971,244	0.2
Banco de Credito del Peru SA	5.85%	01/11/2029	849	877,461	0.2
Bank Leumi Le-Israel BM	7.13%	07/18/2033	1,340	1,335,640	0.3
Braskem Idesa SAPI	6.99%	02/20/2032	1,339	1,044,005	0.2
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029	255	214,042	0.0
Braskem Netherlands Finance BV.....	4.50%	01/10/2028	605	564,011	0.1
Braskem Netherlands Finance BV.....	4.50%	01/31/2030	403	353,008	0.1
Braskem Netherlands Finance BV.....	8.50%	01/12/2031	340	354,624	0.1
BRF SA	4.88%	01/24/2030	560	526,400	0.1
Buffalo Energy Mexico Holdings/Buffalo Energy Infrastructure/ Buffalo Energy	7.88%	02/15/2039	480	514,666	0.1
CA Magnum Holdings	5.38%	10/31/2026	542	528,111	0.1
Canacol Energy Ltd.	5.75%	11/24/2028	723	416,629	0.1
Canacol Energy Ltd.	5.75%	11/24/2028	1,459	840,749	0.2
Cemex SAB de CV(c)	9.13%	03/14/2028	510	554,625	0.1
China Great Wall International Holdings V Ltd.	2.88%	11/23/2026	294	276,911	0.1
China Great Wall International Holdings VI Ltd.	6.38%	01/02/2028	224	229,062	0.0
China Modern Dairy Holdings Ltd.....	2.13%	07/14/2026	630	593,912	0.1
CIBANCO SA Institucion de Banca Multiple Trust CIB/3332.	4.38%	07/22/2031	605	496,100	0.1
Cometa Energia SA de CV.....	6.38%	04/24/2035	429	433,057	0.1
Continuum Green Energy India Pvt./Co-Issuers	7.50%	06/26/2033	560	575,574	0.1
CSN Resources SA	4.63%	06/10/2031	1,323	1,041,452	0.2
CT Trust	5.13%	02/03/2032	785	703,556	0.1
Ecopetrol SA	8.63%	01/19/2029	6,972	7,462,201	1.6
Empresa Generadora de Electricidad Haina SA	5.63%	11/08/2028	695	651,128	0.1
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.25%	07/18/2029	914	824,263	0.2
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.38%	02/15/2031	1,020	888,940	0.2
Engie Energia Chile SA.....	6.38%	04/17/2034	720	758,243	0.2
Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	8.38%	07/23/2029	705	717,852	0.2
Falabella SA.....	3.75%	10/30/2027	563	534,203	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
First Abu Dhabi Bank PJSC	6.32%	04/04/2034	USD 475	\$ 491,891	0.1%
Ford Otomotiv Sanayi AS	7.13%	04/25/2029	715	734,612	0.2
GENM Capital Labuan Ltd.	3.88%	04/19/2031	1,100	983,469	0.2
Geopark Ltd.	5.50%	01/17/2027	620	584,741	0.1
Globo Comunicacao e Participacoes SA	5.50%	01/14/2032	970	893,157	0.2
Gran Tierra Energy, Inc.	9.50%	10/15/2029	823	799,853	0.2
Greenko Dutch BV	3.85%	03/29/2026	828	797,046	0.2
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.	5.50%	04/06/2025	520	516,912	0.1
Huarong Finance 2017 Co., Ltd., Series E	4.25%	11/07/2027	212	201,209	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd., Series E	3.25%	11/13/2024	465	461,922	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd., Series E	4.63%	06/03/2026	574	562,520	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd., Series E	4.88%	11/22/2026	214	210,054	0.0
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	8.55%	09/18/2033	408	456,450	0.1
India Clean Energy Holdings	4.50%	04/18/2027	1,455	1,360,880	0.3
Indika Energy Tbk PT	8.75%	05/07/2029	1,070	1,091,066	0.2
Intercorp Financial Services, Inc.	4.13%	10/19/2027	673	643,980	0.1
Israel Electric Corp., Ltd.	7.75%	12/15/2027	250	264,810	0.1
Israel Electric Corp., Ltd., Series G	4.25%	08/14/2028	580	549,915	0.1
Joy Treasure Assets Holdings, Inc.	4.50%	03/20/2029	740	715,025	0.1
JSW Steel Ltd.	3.95%	04/05/2027	690	657,225	0.1
Lenovo Group Ltd.	3.42%	11/02/2030	600	548,062	0.1
Leviathan Bond Ltd.	6.13%	06/30/2025	91	89,616	0.0
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	1,701	1,584,244	0.3
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	5.88%	07/05/2034	1,333	1,342,648	0.3
Masdar Abu Dhabi Future Energy Co., Series E	4.88%	07/25/2033	1,298	1,307,735	0.3
Melco Resorts Finance Ltd.	5.75%	07/21/2028	242	230,444	0.0
Melco Resorts Finance Ltd.	7.63%	04/17/2032	246	246,297	0.1
MGM China Holdings Ltd.	7.13%	06/26/2031	203	207,630	0.0
Millicom International Cellular SA	7.38%	04/02/2032	230	232,364	0.0
Minejesa Capital BV	4.63%	08/10/2030	989	964,815	0.2
Minejesa Capital BV	5.63%	08/10/2037	1,015	964,565	0.2
Nexa Resources SA	6.75%	04/09/2034	1,000	1,048,598	0.2
OCP SA	7.50%	05/02/2054	755	808,945	0.2
Prosus NV	3.06%	07/13/2031	960	823,500	0.2
Raizen Fuels Finance SA	6.45%	03/05/2034	730	769,087	0.2
Sammaan Capital Ltd.	9.70%	07/03/2027	460	459,430	0.1
Sands China Ltd.	2.85%	03/08/2029	209	187,126	0.0
Sands China Ltd.	5.40%	08/08/2028	491	489,822	0.1
Sasol Financing USA LLC	8.75%	05/03/2029	965	1,006,493	0.2
Saudi Arabian Oil Co.	5.75%	07/17/2054	1,466	1,479,531	0.3
Saudi Arabian Oil Co.	5.88%	07/17/2064	1,575	1,595,239	0.3
Shinhan Financial Group Co., Ltd.(c)	2.88%	05/12/2026	285	270,216	0.1
SierraCol Energy Andina LLC	6.00%	06/15/2028	827	751,024	0.2
Sisecam UK PLC	8.25%	05/02/2029	300	310,771	0.1
Sisecam UK PLC	8.63%	05/02/2032	466	482,664	0.1
Sorik Marapi Geothermal Power PT	7.75%	08/05/2031	475	472,331	0.1
Stillwater Mining Co.	4.00%	11/16/2026	1,145	1,070,575	0.2
TAV Havalimanlari Holding AS	8.50%	12/07/2028	917	955,399	0.2
Temasek Financial I Ltd., Series E	3.10%	08/28/2054	CNH 6,970	997,997	0.2
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	3.25%	08/15/2030	USD 2,052	1,753,188	0.4
TransJamaican Highway Ltd.	5.75%	10/10/2036	671	609,378	0.1
Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030	930	856,763	0.2
Turk Telekomunikasyon AS	7.38%	05/20/2029	735	747,480	0.2
Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	9.00%	10/12/2028	650	696,516	0.1
UEP Penonome II SA	6.50%	10/01/2038	3,221	2,761,263	0.6
UPL Corp., Ltd.	4.50%	03/08/2028	1,100	989,656	0.2
Volcan Cia Minera SAA	4.38%	02/11/2026	1,981	1,695,617	0.4
Woori Bank(c)	4.25%	10/04/2024	200	199,560	0.0
Woori Bank(c)	6.38%	07/24/2029	432	436,860	0.1
Wynn Macau Ltd.	5.63%	08/26/2028	580	552,740	0.1
Xiaomi Best Time International Ltd.	3.38%	04/29/2030	610	560,438	0.1
Yapi ve Kredi Bankasi AS	9.25%	10/16/2028	650	705,452	0.1
				<u>82,383,703</u>	<u>17.3</u>
SCHATZOBIGATIONEN					
Colombian TES, Series B	6.25%	07/09/2036	COP 4,581,900	791,830	0.2
Colombian TES, Series B	7.25%	10/26/2050	76,260,000	12,525,719	2.6
				<u>13,317,549</u>	<u>2.8</u>
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE					
Republic of South Africa Government Bond, Series 2048	8.75%	02/28/2048	ZAR 77,195	3,451,915	0.7
Turkiye Government Bond, Series 10Y	26.20%	10/05/2033	TRY 77,600	2,231,120	0.5
Turkiye Government Bond, Series 5Y	12.60%	10/01/2025	104,665	2,377,633	0.5
				<u>8,060,668</u>	<u>1.7</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
AB SICAV I - Emerging Market Corporate Debt Portfolio - Class S			120,265	\$ 3,453,999	0.7%
				<u>439,378,840</u>	<u>91.5</u>
GELDMARKTINSTRUMENTE					
US-SCHATZWECHSEL					
U.S. Treasury Bill	0.00%	09/17/2024	USD 2,370	2,365,175	0.5
U.S. Treasury Bill	0.00%	10/17/2024	2,380	<u>2,365,135</u>	<u>0.5</u>
				<u>4,730,310</u>	<u>1.0</u>
				<u>444,109,150</u>	<u>92.5</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
AES Andes SA	6.35%	10/07/2079	672	666,510	0.1
Autopistas del Sol SA/Costa Rica	7.38%	12/30/2030	1,701	1,665,173	0.3
Bank Hapoalim BM	3.26%	01/21/2032	734	677,115	0.1
BBFI Liquidating Trust(d)	0.00%	12/30/2099	5,162	1,494,630	0.3
C&W Senior Finance Ltd.	6.88%	09/15/2027	520	511,756	0.1
Credicorp Capital Sociedad Titulizadora SA	10.10%	12/15/2043	PEN 4,185	1,148,408	0.2
First Quantum Minerals Ltd.	9.38%	03/01/2029	USD 320	340,966	0.1
Israel Electric Corp., Ltd., Series G	3.75%	02/22/2032	204	174,675	0.0
JSW Infrastructure Ltd.	4.95%	01/21/2029	530	510,125	0.1
Leviathan Bond Ltd.	6.75%	06/30/2030	505	467,079	0.1
Virgolino de Oliveira Finance SA(b) (d)	10.50%	01/28/2018	1,013	101	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(b) (d)	10.88%	01/13/2020	2,474	247	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(b) (d)	11.75%	02/09/2022	2,554	<u>12,769</u>	<u>0.0</u>
				<u>7,669,554</u>	<u>1.4</u>
STAATSANLEIHEN					
Ghana Government International Bond(a)	8.63%	06/16/2049	3,367	1,744,527	0.4
Lebanon Government International Bond, Series 8Y(b)	6.65%	04/22/2024	3,748	234,250	0.0
Oman Government International Bond	5.63%	01/17/2028	1,611	1,644,730	0.3
Paraguay Government International Bond	3.85%	06/28/2033	1,929	1,748,759	0.4
Venezuela Government International Bond(b)	7.75%	10/13/2019	2,834	365,560	0.1
Venezuela Government International Bond(b)	9.00%	05/07/2023	5,842	<u>826,700</u>	<u>0.2</u>
				<u>6,564,526</u>	<u>1.4</u>
QUASI-STAAANLEIHEN					
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC	7.63%	11/08/2028	1,322	1,044,380	0.2
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC(d)	7.65%	07/19/2025	1,295	1,119,885	0.2
State Agency of Roads of Ukraine	6.25%	06/24/2030	2,984	<u>917,580</u>	<u>0.2</u>
				<u>3,081,845</u>	<u>0.6</u>
				<u>17,315,925</u>	<u>3.4</u>
GELDMARKTINSTRUMENTE					
SCHATZWECHSEL					
Egypt Treasury Bills, Series 364D	0.00%	09/10/2024	EGP 128,750	2,626,373	0.5
				<u>19,942,298</u>	<u>3.9</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$507,771,205)				\$ <u>464,051,448</u>	<u>96.4%</u>
Termineinlagen					
ANZ, Hong Kong(e)	3.05 %	–		98,377	0.0
ANZ, Hong Kong(e)	3.44 %	–		255	0.0
BBH, New York(e)	0.50 %	–		1	0.0
BNP Paribas, Paris(e)	1.71 %	–		26	0.0
HSBC, London(e)	3.90 %	–		233	0.0
HSBC, Singapore(e)	2.11 %	–		85	0.0
Scotiabank, Toronto(e)	3.30 %	–		28	0.0
SEB, Stockholm(e)	4.68 %	–		7,297,280	1.5
SMBC, Tokyo(e)	2.62 %	–		2,174	0.0
Standard Chartered Bank, Johannesburg(e)	6.46 %	–		<u>56,950</u>	<u>0.0</u>
Termineinlagen insgesamt				<u>7,455,409</u>	<u>1.5</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>10,042,523</u>	<u>2.1</u>
Nettovermögen				\$ <u>481,549,380</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Long					
U.S. 10 Yr Ultra Futures	12/19/2024	62	\$ 7,338,281	\$ 7,281,125	\$ (57,156)
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	12/31/2024	15	3,118,172	3,113,203	(4,969)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	12/31/2024	128	14,015,875	14,003,000	(12,875)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	12/19/2024	260	29,686,476	29,526,250	(160,226)
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	12/19/2024	64	8,541,969	8,444,000	(97,969)
					\$ (333,195)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Bank of America NA	CLP 2,111,297	USD 2,247	09/12/2024	\$ (62,852)
Bank of America NA	PEN 4,313	USD 1,161	09/12/2024	10,623
Bank of America NA	USD 2,192	CLP 2,100,474	09/12/2024	106,171
Bank of America NA	INR 635,145	USD 7,546	09/13/2024	(26,779)
Bank of America NA	CNH 6,970	USD 979	09/27/2024	(6,955)
Bank of America NA	GBP 1,860	USD 2,463	11/08/2024	19,123
Barclays Bank PLC	BRL 37,077	USD 6,693	09/04/2024	113,939
Barclays Bank PLC	USD 6,672	BRL 37,077	10/02/2024	(114,854)
BNP Paribas SA	CLP 2,100,474	USD 2,295	09/12/2024	(3,857)
BNP Paribas SA	COP 14,592,287	USD 3,617	09/12/2024	132,473
BNP Paribas SA	HUF 936,289	USD 2,561	09/12/2024	(71,987)
BNP Paribas SA	USD 2,078	HUF 753,712	09/12/2024	41,020
BNP Paribas SA	MXN 42,404	USD 2,175	09/26/2024	29,141
BNP Paribas SA	USD 2,298	MXN 42,640	09/26/2024	(140,037)
BNP Paribas SA	ZAR 62,285	USD 3,479	10/17/2024	(1,700)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 8	USD 9	09/09/2024	103
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2	USD 2	09/09/2024	(25)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 85,827	EUR 78,484	09/09/2024	949,374
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 856	EUR 770	09/09/2024	(5,090)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 78	USD 53	09/23/2024	143
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD 105	USD 71	09/23/2024	(374)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 216	USD 282	09/23/2024	(2,103)
Brown Brothers Harriman & Co.+	NZD 4	USD 2	09/23/2024	(36)
Brown Brothers Harriman & Co.+	PLN 268	USD 70	09/23/2024	742
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 15	USD 11	09/23/2024	16
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD 8	USD 6	09/23/2024	(30)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 41,681	AUD 61,812	09/23/2024	177,150
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 317	AUD 466	09/23/2024	(1,010)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 857	CAD 1,167	09/23/2024	9,691
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 22	CHF 19	09/23/2024	169
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 957	GBP 735	09/23/2024	7,919
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,391	NZD 3,889	09/23/2024	39,891
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 0*	NZD 1	09/23/2024	(0)**
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 593	PLN 2,281	09/23/2024	(4,390)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 5,126	SGD 6,687	09/23/2024	3,853
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 51	SGD 67	09/23/2024	(49)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 23,801	ZAR 425,702	09/23/2024	38,768
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 124	ZAR 2,194	09/23/2024	(787)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 1,059	USD 59	09/23/2024	282
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR 1,335	USD 75	09/23/2024	(34)
Citibank NA	USD 6,242	BRL 35,814	09/04/2024	112,907
Citibank NA	USD 696	HUF 250,801	09/12/2024	9,575
Deutsche Bank AG	COP 2,180,968	USD 541	09/12/2024	20,109
JPMorgan Chase Bank NA	USD 223	BRL 1,263	09/04/2024	1,503
Morgan Stanley & Co., LLC	COP 42,537,884	USD 10,695	09/12/2024	535,840
Morgan Stanley & Co., LLC	EUR 3,992	USD 4,376	10/25/2024	(47,100)
Standard Chartered Bank	USD 7,462	INR 626,795	09/13/2024	11,560
Standard Chartered Bank	EUR 2,268	USD 2,495	10/25/2024	(18,193)
				\$ 1,863,843
			Wertsteigerung	\$ 2,372,085
			Wertminderung	\$ (508,242)

+ Zur Absicherung des Portfolios oder der Anteilklassen.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nomineller Betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Kaufkontrakte					
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Qatar Government International Bond, 9.75%, 06/15/2030, 06/20/2029	06/20/2029	USD 36,720	\$ (1,011,234)	\$ (77,271)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nomineller Betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 5,150	03/21/2033	1 Day SOFR	3.209%	\$ (87,652)
Swaps insgesamt					\$ (164,923)

* Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

** Anteilsbetrag weniger als 0.50.

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

(e) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD	– Australian Dollar
BRL	– Brazilian Real
CAD	– Canadian Dollar
CHF	– Swiss Franc
CLP	– Chilean Peso
CNH	– Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
COP	– Colombian Peso
EGP	– Egyptian Pound
EUR	– Euro
GBP	– Great British Pound
HUF	– Hungarian Forint
INR	– Indian Rupee
MXN	– Mexican Peso
NZD	– New Zealand Dollar
PEN	– Peruvian Sol
PLN	– Polish Zloty
SGD	– Singapore Dollar
TRY	– Turkish Lira
USD	– United States Dollar
ZAR	– South African Rand

Glossar:

CBT	– Chicago Board of Trade
CJSC	– Closed Joint Stock Company
INTRCONX	– Intercontinental Exchange
LCH	– London Clearing House
PJSC	– Public Joint Stock Company
SOFR	– Secured Overnight Financing Rate

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Bellemeade Re Ltd., Series 2022-1, Class M2(a)	9.95%	01/26/2032	USD 500 \$	514,633	0.0%
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2020-SBT1, Class 1B1(a)	12.21%	02/25/2040	1,000	1,075,000	0.1
Series 2020-SBT1, Class 2B1(a)	12.06%	02/25/2040	4,000	4,332,618	0.4
Series 2020-SBT1, Class 2M2(a)	9.11%	02/25/2040	2,840	3,012,116	0.3
Series 2022-R01, Class 1M2(a)	7.25%	12/25/2041	4,215	4,269,094	0.4
Series 2022-R02, Class 2B1(a)	9.85%	01/25/2042	1,000	1,056,250	0.1
Series 2022-R02, Class 2B2(a)	13.00%	01/25/2042	1,000	1,085,630	0.1
Series 2022-R02, Class 2M1(a)	6.55%	01/25/2042	4,553	4,552,760	0.4
Series 2022-R03, Class 1M1(a)	7.45%	03/25/2042	4,727	4,800,558	0.4
Series 2022-R05, Class 2B2(a)	12.35%	04/25/2042	1,000	1,091,102	0.1
Series 2022-R07, Class 1M1(a)	8.30%	06/25/2042	6,209	6,412,948	0.6
Series 2022-R08, Class 1M1(a)	7.90%	07/25/2042	3,602	3,697,044	0.3
Series 2023-R02, Class 1M2(a)	8.70%	01/25/2043	3,000	3,160,994	0.3
Series 2023-R05, Class 1B1(a)	10.10%	06/25/2043	3,000	3,240,792	0.3
Series 2023-R05, Class 1B2(a)	12.20%	06/25/2043	1,500	1,674,898	0.1
Series 2023-R06, Class 1B1(a)	9.25%	07/25/2043	6,500	6,888,699	0.6
Series 2023-R07, Class 2B1(a)	9.85%	09/25/2043	3,000	3,209,084	0.3
Series 2023-R07, Class 2M1(a)	7.30%	09/25/2043	5,746	5,778,618	0.5
Series 2024-R04, Class 1M1(a)	6.45%	05/25/2044	3,196	3,196,373	0.3
Series 2024-R05, Class 2A1(a)	6.35%	07/25/2044	5,474	5,476,067	0.5
Series 2024-R05, Class 2M1(a)	6.35%	07/25/2044	3,397	3,398,340	0.3
Series 2024-R05, Class 2M2(a)	7.05%	07/25/2044	2,100	2,102,709	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2018-HQA2, Class B2(a)	16.46%	10/25/2048	7,550	9,494,125	0.8
Series 2019-DNA4, Class B2(a)	11.71%	10/25/2049	3,850	4,245,023	0.4
Series 2019-FTR3, Class B2(a)	10.26%	09/25/2047	6,480	6,876,501	0.6
Series 2019-HQA3, Class B2(a)	12.96%	09/25/2049	3,244	3,677,413	0.3
Series 2020-DNA1, Class B2(a)	10.71%	01/25/2050	4,500	4,966,828	0.4
Series 2020-DNA2, Class B2(a)	10.26%	02/25/2050	7,151	7,651,570	0.7
Series 2020-DNA5, Class B2(a)	16.85%	10/25/2050	3,000	4,120,805	0.4
Series 2020-HQA1, Class B2(a)	10.56%	01/25/2050	5,500	5,955,863	0.5
Series 2020-HQA2, Class B2(a)	13.06%	03/25/2050	5,500	6,582,397	0.6
Series 2021-DNA1, Class B2(a)	10.10%	01/25/2051	2,000	2,109,987	0.2
Series 2021-DNA3, Class B2(a)	11.60%	10/25/2033	1,000	1,181,880	0.1
Series 2021-DNA5, Class B2(a)	10.85%	01/25/2034	3,000	3,375,690	0.3
Series 2021-DNA6, Class B2(a)	12.85%	10/25/2041	1,500	1,622,820	0.1
Series 2021-DNA7, Class B2(a)	13.15%	11/25/2041	1,000	1,081,164	0.1
Series 2021-DNA7, Class M1(a)	6.20%	11/25/2041	5,699	5,688,845	0.5
Series 2021-DNA7, Class M2(a)	7.15%	11/25/2041	4,650	4,699,219	0.4
Series 2021-HQA3, Class M1(a)	6.20%	09/25/2041	9,738	9,752,331	0.9
Series 2021-HQA4, Class M1(a)	6.30%	12/25/2041	6,964	6,933,893	0.6
Series 2022-DNA1, Class B1(a)	8.75%	01/25/2042	1,000	1,032,674	0.1
Series 2022-DNA1, Class M1B(a)	7.20%	01/25/2042	7,812	7,882,810	0.7
Series 2022-DNA2, Class B1(a)	10.10%	02/25/2042	1,000	1,055,496	0.1
Series 2022-DNA2, Class M1A(a)	6.65%	02/25/2042	4,192	4,196,147	0.4
Series 2022-DNA3, Class M1A(a)	7.35%	04/25/2042	8,154	8,252,724	0.7
Series 2022-HQA1, Class M1A(a)	7.45%	03/25/2042	2,816	2,836,633	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes 2018-DNA3, Series 2018-DNA3, Class B2(a)					
	13.21%	09/25/2048	2,000	2,326,996	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes 2020-DNA2 Series 2021-DNA2, Class B1(a)					
	8.75%	08/25/2033	2,000	2,214,868	0.2
Series 2021-DNA2, Class B2(a)	11.35%	08/25/2033	1,250	1,462,500	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes 2020-DNA4, Series 2020-DNA4, Class B1(a)					
	11.46%	08/25/2050	5,861	6,797,850	0.6
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes 2020-DNA5, Series 2020-DNA5, Class B1(a)					
	10.15%	10/25/2050	7,495	8,603,118	0.8
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes 2020-HQA5, Series 2020-HQA5, Class B1(a)					
	9.35%	11/25/2050	7,000	7,861,766	0.7
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes 2022-DNA1, Series 2022-DNA1, Class M1A(a)					
	6.35%	01/25/2042	5,830	5,829,779	0.5
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes 2022-DNA4, Series 2022-DNA4, Class M1A(a)					
	7.55%	05/25/2042	2,533	2,576,077	0.2

AB FCP I
Mortgage Income Portfolio

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes 2023-DNA1, Series 2023-DNA1, Class B1(a)	13.50%	03/25/2043	USD 3,000	\$ 3,441,960	0.3%
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-DNA1 Series 2015-DNA1, Class B(a)	14.66%	10/25/2027	9,699	10,095,028	0.9
Series 2015-DNA1, Class M3(a)	8.76%	10/25/2027	192	193,037	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-DNA2, Series 2015-DNA2, Class B(a)	13.01%	12/25/2027	8,701	9,023,941	0.8
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-DNA3, Series 2015-DNA3, Class B(a)	14.81%	04/25/2028	7,382	7,903,651	0.7
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-HQ2, Series 2015-HQ2, Class B(a)	13.41%	05/25/2025	9,159	9,560,425	0.8
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-HQA1, Series 2015-HQA1, Class B(a)	14.26%	03/25/2028	7,386	7,687,045	0.7
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2015-HQA2, Series 2015-HQA2, Class B(a)	15.96%	05/25/2028	4,281	4,473,443	0.4
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-DNA1, Series 2016-DNA1, Class B(a)	15.46%	07/25/2028	3,950	4,357,245	0.4
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-DNA2, Series 2016-DNA2, Class B(a)	15.96%	10/25/2028	6,712	7,485,688	0.7
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-DNA3, Series 2016-DNA3, Class B(a)	16.71%	12/25/2028	1,469	1,663,312	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-DNA4, Series 2016-DNA4, Class B(a)	14.06%	03/25/2029	3,236	3,598,790	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-HQA1, Series 2016-HQA1, Class B(a)	18.21%	09/25/2028	2,478	2,827,670	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Debt Notes 2016-HQA2, Series 2016-HQA2, Class B(a)	16.96%	11/25/2028	496	559,225	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Securitized Participation Interests Trust 2018-SPI1, Series 2018-SPI1, Class B(b)	3.79%	02/25/2048	1,248	835,154	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Securitized Participation Interests Trust 2018-SPI2, Series 2018-SPI2, Class B(b)	3.84%	05/25/2048	1,577	1,103,998	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes Securitized Participation Interests Trust 2018-SPI4, Series 2018-SPI4, Class B(b)	4.51%	11/25/2048	1,893	1,331,202	0.1
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities Series 2014-C04, Class 1M2(a)	10.36%	11/25/2024	329	331,606	0.0
Series 2016-C01, Class 1B(a)	17.21%	08/25/2028	2,675	3,007,629	0.3
Series 2016-C01, Class 2M2(a)	12.41%	08/25/2028	243	254,786	0.0
Series 2016-C02, Class 1B(a)	17.71%	09/25/2028	6,049	6,951,911	0.6
Series 2016-C03, Class 1B(a)	17.21%	10/25/2028	3,464	3,982,494	0.4
Series 2016-C03, Class 2B(a)	18.21%	10/25/2028	3,220	3,698,102	0.3
Series 2016-C04, Class 1B(a)	15.71%	01/25/2029	3,204	3,651,153	0.3
Series 2016-C05, Class 2B(a)	16.21%	01/25/2029	4,903	5,574,965	0.5
Series 2016-C06, Class 1B(a)	14.71%	04/25/2029	8,953	10,136,821	0.9
Series 2016-C07, Class 2B(a)	14.96%	05/25/2029	3,553	4,027,855	0.4
JP Morgan Madison Avenue Securities Trust Series 2014-CH1, Class M2(a)	9.71%	11/25/2024	458	479,188	0.0
Series 2015-CH1, Class M2(a)	10.96%	10/25/2025	1,096	1,123,692	0.1
PMT Credit Risk Transfer Trust Series 2019-3R, Class A(a)	9.16%	11/27/2031	696	698,006	0.1
Series 2020-1R, Class A(a)	8.81%	02/25/2025	1,000	998,772	0.1
Wells Fargo Credit Risk Transfer Securities Trust, Series 2015-WF1, Class 1M2(a)	10.71%	11/25/2025	527	545,183	0.0
				348,575,096	30.6

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH					
Adjustable Rate Mortgage Trust, Series 2007-1, Class 3A22	4.99%	03/25/2037	USD 1,456	\$ 1,315,777	0.1%
Alternative Loan Trust, Series 2005-50CB, Class 1A1	5.50%	11/25/2035	721	589,019	0.1
Angel Oak Mortgage Trust, Series 2021-2, Class A1	0.99%	04/25/2066	2,655	2,251,368	0.2
Argent Sec, Inc. Asset Backed Pas Thr Cer Ser, Series 2003-W1, Class MF6(a)	3.73%	12/25/2033	1,990	1,713,711	0.2
BCAP LLC Trust Series 2009-RR3, Class 2A2	4.35%	05/26/2037	2,473	2,223,414	0.2
Series 2010-RR9, Class 7A2	4.14%	01/27/2037	3,001	2,600,219	0.2
Series 2012-RR2, Class 5A14	4.57%	02/26/2036	3,304	2,991,805	0.3
Bear Stearns ALT-A Trust, Series 2006-3, Class 21A1	4.54%	05/25/2036	2,169	1,567,502	0.1
Brean Asset Backed Securities Trust Series 2021-RM2, Class M2	1.75%	10/25/2061	1,578	1,297,397	0.1
Series 2022-RM3, Class M2	1.75%	02/25/2062	2,563	1,866,219	0.2
Chase Mortgage Finance Trust Series 2006-A1, Class 3A1	4.36%	09/25/2036	1,064	921,489	0.1
Series 2007-S5, Class 1A17	6.00%	07/25/2037	1,588	734,982	0.1
CHL Mortgage Pass-Through Trust, Series 2006-10, Class 1A8	6.00%	05/25/2036	1,132	497,712	0.0
Citicorp Mortgage Securities Trust Series 2006-5, Class 1A3	6.00%	10/25/2036	1,391	1,195,233	0.1
Series 2007-2, Class 1A3	6.00%	02/25/2037	5,042	4,620,794	0.4
Citigroup Mortgage Loan Trust, Series 2006-AR5, Class 2A3A	5.88%	07/25/2036	2,963	2,608,173	0.2
CitiMortgage Alternative Loan Trust, Series 2007-A6, Class 1A11	6.00%	06/25/2037	86	74,274	0.0
Countrywide Asset-Backed Certificates, Series 2005-SD3, Class M3(a)	5.50%	11/25/2035	4,717	4,253,620	0.4
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates, Series 2009-11R, Class 5A10	4.59%	08/26/2036	2,601	2,358,212	0.2
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates, Series 2005-10, Class 3A3	5.50%	11/25/2035	1,317	738,679	0.1
Deutsche Alt-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust, Series 2005-2, Class 1A7	5.05%	04/25/2035	3,239	3,055,237	0.3
GSAA Home Equity Trust, Series 2006-10, Class AF5(a)	6.95%	06/25/2036	3,495	861,964	0.1
HarborView Mortgage Loan Trust, Series 2007-2, Class 2A1A(a)	5.55%	05/25/2038	1,351	1,061,629	0.1
HomeBanc Mortgage Trust, Series 2007-1, Class 11A1	4.68%	04/25/2047	1,151	925,305	0.1
JP Morgan Alternative Loan Trust, Series 2006-S4, Class A4(a)	6.46%	12/25/2036	1,849	1,857,774	0.2
JP Morgan Mortgage Trust Series 2006-A3, Class 5A2	5.55%	04/25/2036	1,035	878,950	0.1
Series 2006-A4, Class 3A4	4.52%	06/25/2036	1,286	876,561	0.1
Series 2018-3, Class B2	3.70%	09/25/2048	2,362	2,128,209	0.2
Series 2018-6, Class B2	3.89%	12/25/2048	1,462	1,340,210	0.1
Series 2018-9, Class B2	4.25%	02/25/2049	2,286	2,119,490	0.2
Luminent Mortgage Trust, Series 2007-1, Class 1A1(a)	5.71%	11/25/2036	2,259	1,994,238	0.2
Mill City Mortgage Loan Trust Series 2018-1, Class B5(a)	3.79%	05/25/2062	5,263	2,682,612	0.2
Series 2018-2, Class B5(a)	0.94%	05/25/2058	6,713	3,418,084	0.3
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust, Series 2006-7, Class 4A4	6.00%	06/25/2036	375	175,332	0.0
Morgan Stanley Re-REMIC Trust, Series 2010-R9, Class 3C	6.00%	11/26/2036	3,384	2,641,043	0.2
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust, Series 2005-AR5, Class 1A1	4.00%	10/25/2035	1,042	777,976	0.1
Option One Mortgage Loan Trust, Series 2007-FXD1, Class 1A1	5.87%	01/25/2037	4,164	3,570,465	0.3
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust, Series 2005-5, Class MV2(a)	3.27%	11/25/2035	3,352	2,994,605	0.3
RBSGC Structured Trust, Series 2008-B, Class A1	6.00%	06/25/2037	3,384	2,906,778	0.3
Residential Accredited Loans, Inc. Trust, Series 2006-QS9, Class 1A10	6.50%	07/25/2036	1,243	1,029,100	0.1
RFMSI Trust Series 2006-S9, Class A1	6.25%	09/25/2036	1,773	1,465,048	0.1
Series 2007-SA4, Class 3A1	5.96%	10/25/2037	2,815	1,788,716	0.2

AB FCP I
Mortgage Income Portfolio

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Series 2007-9, Class 1A1(a)	7.01%	10/25/2037	USD 2,358	\$ 2,154,522	0.2%
Verus Securitization Trust, Series 2022-4, Class A1	4.47%	04/25/2067	5,858	5,835,810	0.5
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust Series 2005-AR15, Class A1C3(a)	6.35%	11/25/2045	5,427	5,553,522	0.5
Series 2005-AR17, Class A1B3(a)	6.09%	12/25/2045	1,183	1,061,211	0.1
Wells Fargo Alternative Loan Trust, Series 2007-PA6, Class A1(a)	6.14%	12/28/2037	4,366	<u>3,972,237</u>	<u>0.3</u>
				<u>95,546,227</u>	<u>8.7</u>
NICHT STAATLICH VARIABEL VERZINSLICH					
Alternative Loan Trust Series 2005-19CB, Class A2(a)	5.08%	06/25/2035	56	47,981	0.0
Series 2006-29T1, Class 2A11(a)	5.79%	10/25/2036	1,912	856,897	0.1
Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust Series 2005-AC7, Class A2(a)	6.68%	10/25/2035	229	182,817	0.0
Series 2005-AC9, Class A4(a)	6.57%	12/25/2035	226	134,383	0.0
BNC Mortgage Loan Trust, Series 2006-1, Class A4(a)	3.55%	10/25/2036	7,500	4,493,344	0.4
Chase Mortgage Finance Corp. Series 2016-SH1, Class M4(b)	3.75%	04/25/2045	852	759,886	0.1
Series 2016-SH2, Class M4(b)	3.75%	12/25/2045	569	514,843	0.0
Citigroup Mortgage Loan Trust, Series 2007-12, Class 2A1(b)	6.50%	10/25/2036	1,226	623,313	0.1
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2003-HE3, Class M4(a)	9.89%	12/25/2033	1,302	1,431,505	0.1
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates, Series 2010-2R, Class 1A3(b)	5.75%	07/26/2037	2,628	2,237,493	0.2
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates, Series 2005-9, Class 4A1(a)	4.70%	10/25/2035	44	44,011	0.0
Deutsche Alt-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust, Series 2005-6, Class 1A5(a)	6.50%	12/25/2035	1,763	1,357,742	0.1
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust, Series 2005-FA8, Class 1A12(a)	5.50%	11/25/2035	81	39,084	0.0
Flagstar Mortgage Trust Series 2018-3INV, Class B1(b)	4.45%	05/25/2048	285	269,386	0.0
Series 2018-3INV, Class B2(b)	4.45%	05/25/2048	519	487,595	0.0
Series 2018-3INV, Class B3(b)	4.45%	05/25/2048	384	360,455	0.0
Home Equity Asset Trust, Series 2007-3, Class M1(a)	5.92%	08/25/2037	3,888	4,337,750	0.4
JP Morgan Resecuritization Trust, Series 2015-4, Class 1A7(a)	4.42%	06/26/2047	3,799	3,258,278	0.3
Lehman Mortgage Trust, Series 2007-1, Class 3A2(a) (c)	1.86%	02/25/2037	886	74,715	0.0
Lehman XS Trust, Series 2007-3, Class 4BA1(a)	5.70%	03/25/2037	4,102	2,651,058	0.2
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust, Series 2003-WMC2, Class B1(a)	9.67%	02/25/2034	1,462	1,061,974	0.1
RBSGC Mortgage Loan Trust, Series 2007-A, Class 3A1(a)	5.74%	01/25/2037	12,111	2,998,665	0.3
Residential Accredited Loans, Inc. Trust, Series 2006-QO3, Class A1(a)	5.81%	04/25/2046	2,333	600,736	0.1
Residential Asset Securitization Trust Series 2006-A10, Class A1(a)	6.04%	09/25/2036	3,067	717,071	0.1
Series 2006-A10, Class A2(a) (c)	0.46%	09/25/2036	3,067	339,967	0.0
Sequoia Mortgage Trust, Series 2018-7, Class B2(b)	4.25%	09/25/2048	2,136	2,019,087	0.2
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust, Series 2007-2, Class 1A9(a)	5.71%	04/25/2037	6,941	<u>2,041,293</u>	<u>0.2</u>
				<u>33,941,329</u>	<u>3.0</u>
VARIABEL VERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICS Series 3928, Class SE(a) (c)	1.11%	09/15/2041	2,750	349,102	0.0
Series 4416, Class BS(a) (c)	0.63%	12/15/2044	1,235	152,147	0.0
Series 4719, Class JS(a) (c)	0.68%	09/15/2047	2,366	301,182	0.0
Series 4767, Class SB(a) (c)	0.73%	03/15/2048	2,493	323,222	0.0
Federal National Mortgage Association REMICS Series 2012-122, Class MS(a) (c)	0.64%	11/25/2042	1,206	179,852	0.0
Series 2013-15, Class SA(a) (c)	0.69%	03/25/2043	2,878	399,874	0.0
Series 2014-40, Class HS(a) (c)	1.24%	07/25/2044	1,709	315,634	0.0
Series 2015-90, Class SL(a) (c)	0.69%	12/25/2045	3,244	445,053	0.0
Series 2016-106, Class ES(a) (c)	0.54%	01/25/2047	1,181	167,053	0.0
Series 2017-20, Class SJ(a) (c)	0.64%	04/25/2047	2,900	393,713	0.0
Series 2018-28, Class SB(a) (c)	0.74%	05/25/2048	3,055	411,280	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2018-30, Class SA(a) (c)	0.74%	05/25/2048	USD 2,440	\$ 346,391	0.0%
Series 2018-58, Class SA(a) (c)	0.74%	08/25/2048	1,540	203,518	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2014-181, Class TV(a) (c)	0.80%	02/16/2035	1,927	93,469	0.0
Series 2015-3, Class DS(a) (c)	0.15%	11/20/2041	1,373	40,396	0.0
				<u>4,121,886</u>	<u>0.0</u>
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICS,					
Series 5040, Class AI(d)	3.50%	11/25/2050	2,178	373,916	0.0
Federal National Mortgage Association REMICS					
Series 2015-30, Class EI(d)	5.00%	05/25/2045	360	52,705	0.0
Series 2016-64, Class BI(d)	5.00%	09/25/2046	3,020	391,341	0.0
Government National Mortgage Association,					
Series 2021-117, Class MI(d)	3.50%	05/20/2042	12,168	1,849,460	0.2
				<u>2,667,422</u>	<u>0.2</u>
				<u>484,851,960</u>	<u>42.5</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 10 Ltd., Series 2021-10A, Class D(a)	8.46%	04/15/2034	3,500	3,503,167	0.3
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class D(a)	8.71%	04/15/2034	3,000	3,004,950	0.3
AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class E(a)	11.92%	04/15/2034	1,000	1,001,082	0.1
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class E(a)	11.69%	07/20/2034	3,250	3,160,739	0.3
AGL CLO 9 Ltd., Series 2020-9A, Class DR(a)	8.83%	04/20/2037	4,000	4,026,488	0.4
AIMCO CLO 18 Ltd., Series 2022-18A, Class D1R(a)	8.13%	07/20/2037	2,000	1,989,592	0.2
Apidos CLO Xlix, Series 2024-49A, Class B(a)	6.84%	10/24/2037	4,000	4,000,692	0.3
Apidos CLO Xlix, Series 2024-49A, Class D1(a)	8.09%	10/24/2037	2,500	2,500,432	0.2
Apidos CLO XV, Series 2013-15A, Class A1RR(a)	6.55%	04/20/2031	506	507,080	0.0
Apidos CLO XXXII, Series 2019-32A, Class CR(a)	7.08%	01/20/2033	4,000	3,998,012	0.3
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class D(a)	8.19%	04/20/2034	3,500	3,484,701	0.3
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class E(a)	11.29%	04/20/2034	3,250	3,244,686	0.3
Apidos Loan Fund Ltd., Series 2024-1A, Class B(a)	7.07%	04/25/2035	2,000	2,003,332	0.2
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2020-1A, Class BR(a)	7.08%	04/18/2033	4,000	4,008,112	0.4
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2021-4A, Class D(a)	8.64%	10/20/2034	5,000	4,954,955	0.4
Bain Capital Credit CLO, Series 2019-1A, Class AR2(a)	6.35%	04/19/2034	5,500	5,499,868	0.5
Bain Capital Credit CLO, Series 2019-2A, Class BR2(a)	6.84%	10/17/2032	3,000	3,000,894	0.3
Ballyrock CLO 14 Ltd., Series 2020-14A, Class A1AR(a)	6.68%	07/20/2037	4,000	4,004,800	0.3
Ballyrock CLO 14 Ltd., Series 2020-14A, Class C1R(a)	8.30%	07/20/2037	2,000	1,987,586	0.2
Ballyrock CLO 17 Ltd., Series 2021-17A, Class D(a)	11.52%	10/20/2034	2,000	1,916,712	0.2
Ballyrock CLO Ltd., Series 2018-1A, Class D(a)	11.34%	04/20/2031	1,000	985,052	0.1
Black Diamond CLO Ltd., Series 2016-1A, Class A2AR(a)	7.29%	04/26/2031	5,000	5,001,660	0.4
BlueMountain Fuji US CLO II Ltd., Series 2017-2A, Class D(a)	11.69%	10/20/2030	1,000	913,700	0.1
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.,					
Series 2014-1A, Class A1R2(a)	6.52%	04/17/2031	911	914,999	0.1
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.,					
Series 2014-3RA, Class A1A(a)	6.58%	07/27/2031	1,699	1,702,810	0.1
CIFC Funding Ltd., Series 2013-3RA, Class A1(a)	6.52%	04/24/2031	1,062	1,064,421	0.1
Clover CLO LLC, Series 2021-3A, Class D(a)	8.65%	01/25/2035	3,000	3,019,335	0.3
Clover CLO LLC, Series 2021-3A, Class E(a)	12.01%	01/25/2035	3,400	3,324,819	0.3
Dryden 45 Senior Loan Fund,					
Series 2016-45A, Class BR(a)	7.26%	10/15/2030	2,200	2,203,208	0.2
Dryden 53 CLO Ltd., Series 2017-53A, Class B(a)	6.96%	01/15/2031	4,525	4,534,679	0.4
Dryden 60 CLO Ltd., Series 2018-60A, Class A(a)	6.61%	07/15/2031	5,768	5,771,703	0.5
Dryden 64 CLO Ltd., Series 2018-64A, Class B(a)	6.94%	04/18/2031	3,800	3,802,835	0.3
Dryden 70 CLO Ltd., Series 2018-70A, Class B(a)	7.25%	01/16/2032	2,462	2,466,605	0.2
Eaton Vance CLO Ltd., Series 2014-1RA, Class D(a)	8.61%	07/15/2030	1,500	1,495,584	0.1
Elmwood CLO 15 Ltd., Series 2022-2A, Class D(a)	8.95%	04/22/2035	4,000	4,017,508	0.4
GoldenTree Loan Management US CLO 21 Ltd.,					
Series 2024-21A, Class B1(a)	7.03%	07/20/2037	3,000	3,003,084	0.3
GoldenTree Loan Management US CLO 21 Ltd.,					
Series 2024-21A, Class D(a)	8.38%	07/20/2037	3,000	3,012,930	0.3
Goldentree Loan Management US CLO 3 Ltd.,					
Series 2018-3A, Class C(a)	7.44%	04/20/2030	1,500	1,503,301	0.1
Goldentree Loan Management US CLO 6 Ltd.,					
Series 2019-6A, Class BR(a)	7.08%	04/20/2035	4,000	4,012,800	0.4
Goldentree Loan Management US CLO 7 Ltd.,					
Series 2020-7A, Class DR(a)	8.69%	04/20/2034	1,000	1,002,124	0.1
GREYWOLF CLO VI Ltd., Series 2018-1A, Class A2(a)	7.17%	04/26/2031	5,000	5,002,475	0.4
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.,					
Series 2018-1A, Class C(a)	8.74%	07/21/2031	2,000	1,952,694	0.2
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class B(a)	7.11%	04/15/2034	3,000	3,001,809	0.3
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(a)	12.02%	04/15/2034	3,000	3,002,115	0.3
Juniper Valley Park CLO Ltd., Series 2023-1A, Class AR(a)	6.53%	07/20/2036	3,000	3,001,182	0.3
KKR CLO 21 Ltd., Series 21, Class A(a)	6.56%	04/15/2031	2,841	2,843,034	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Madison Park Funding XXVIII Ltd., Series 2018-28A, Class B(a)	7.16%	07/15/2030	USD 1,400	\$ 1,403,010	0.1%
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class DR(a)	8.29%	10/20/2030	2,000	2,000,192	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 Ltd., Series 2017-26A, Class C(a)	7.29%	10/18/2030	1,000	1,002,238	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 Ltd., Series 2019-33A, Class DR(a)	8.45%	10/16/2033	1,875	1,878,703	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 Ltd., Series 2020-39A, Class DR(a)	9.18%	04/20/2038	1,250	1,264,466	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 Ltd., Series 2020-39A, Class ER(a)	12.48%	04/20/2038	2,500	2,516,500	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 Ltd., Series 2021-42A, Class E(a)	11.50%	07/16/2035	3,625	3,622,680	0.3
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 43 Ltd., Series 2021-43A, Class D(a)	8.65%	07/17/2035	3,000	3,005,835	0.3
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 44 Ltd., Series 2021-44A, Class E(a)	11.55%	10/16/2034	1,500	1,500,081	0.1
New Mountain CLO 3 Ltd., Series CLO-3A, Class D(a)	8.89%	10/20/2034	5,000	5,005,485	0.4
New Mountain CLO 5 Ltd., Series CLO-5A, Class D(a)	9.20%	04/20/2036	2,000	2,005,250	0.2
OCP CLO Ltd., Series 2014-5A, Class A1R(a)	6.62%	04/26/2031	2,733	2,735,121	0.2
OCP CLO Ltd., Series 2018-15A, Class A1(a)	6.64%	07/20/2031	2,734	2,734,833	0.2
OCP CLO Ltd., Series 2018-15A, Class D(a)	11.39%	07/20/2031	1,000	999,962	0.1
OCP CLO Ltd., Series 2024-34A, Class B(a)	6.93%	10/15/2037	3,000	2,993,478	0.3
OCP CLO Ltd., Series 2024-34A, Class D1(a)	8.22%	10/15/2037	3,000	2,993,433	0.3
Octagon Investment Partners XVI Ltd., Series 2013-1A, Class A1R(a)	6.57%	07/17/2030	3,094	3,095,950	0.3
Onex CLO Subsidiary Ltd., Series 2024-33A, Class B(a)	7.18%	07/20/2037	4,000	3,998,456	0.3
Onex CLO Subsidiary Ltd., Series 2024-33A, Class D1(a)	8.58%	07/20/2037	1,250	1,244,621	0.1
Peace Park CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(a)	11.54%	10/20/2034	2,830	2,833,178	0.2
Pikes Peak CLO 10, Series 2022-10A, Class D(a)	9.11%	04/22/2034	4,000	4,010,992	0.4
Pikes Peak CLO 7, Series 2021-7A, Class DR(a)	9.22%	02/25/2037	5,000	4,996,505	0.4
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class A(a)	6.71%	07/20/2034	5,000	5,005,000	0.4
Pikes Peak CLO 8, Series 2021-8A, Class D(a)	8.64%	07/20/2034	5,000	5,001,020	0.4
PPM CLO 5 Ltd., Series 2021-5A, Class E(a)	12.04%	10/18/2034	1,400	1,334,199	0.1
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2017-3A, Class B(a)	7.01%	10/20/2030	3,000	3,001,677	0.3
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2018-1A, Class D(a)	8.39%	05/20/2031	3,450	3,452,795	0.3
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2018-2A, Class B(a)	7.34%	10/20/2031	7,000	7,009,093	0.6
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(a)	11.90%	07/20/2034	3,000	2,999,364	0.3
Silver Point CLO 3 Ltd., Series 2023-3A, Class D(a)	11.18%	11/29/2036	2,500	2,601,853	0.2
Silver Point CLO 4 Ltd., Series 2024-4A, Class D(a)	9.36%	04/15/2037	3,000	3,018,528	0.3
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class B1R(a)	7.29%	07/20/2031	5,000	5,006,600	0.4
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class CR(a)	7.89%	07/20/2031	2,000	2,001,722	0.2
TIAA CLO I Ltd., Series 2016-1A, Class DR(a)	9.04%	07/20/2031	4,000	4,000,288	0.3
Venture XXVII CLO Ltd., Series 2017-27A, Class D(a)	9.54%	07/20/2030	1,500	1,491,929	0.1
Voya CLO Ltd., Series 2018-3A, Class BR2(a)	7.10%	10/15/2031	4,000	4,000,660	0.3
Wehle Park CLO Ltd., Series 2022-1A, Class D(a)	8.63%	04/21/2035	3,000	3,010,248	0.3
				245,130,291	21.5

DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN

NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS

225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E	4.80%	02/10/2036	2,000	1,539,069	0.1
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2013-WBRK, Class D	3.65%	03/10/2037	3,000	2,477,542	0.2
Banc of America Commercial Mortgage Trust Series 2015-UBS7, Class AS	3.99%	09/15/2048	1,140	1,112,871	0.1
Series 2015-UBS7, Class XA(d)	0.87%	09/15/2048	57,691	263,390	0.0
BANK					
Series 2017-BNK5, Class AS	3.62%	06/15/2060	2,500	2,381,889	0.2
Series 2017-BNK6, Class AS	3.74%	07/15/2060	2,500	2,387,854	0.2
Series 2017-BNK8, Class XA(d)	0.84%	11/15/2050	29,790	557,340	0.0
Series 2018-BN13, Class AS	4.47%	08/15/2061	5,000	4,809,896	0.4
Series 2018-BN15, Class AS	4.74%	11/15/2061	3,208	3,136,371	0.3
BBCMS Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class AS	3.90%	02/15/2050	2,500	2,391,241	0.2
Benchmark Mortgage Trust					
Series 2018-B1, Class A5	3.67%	01/15/2051	4,000	3,830,969	0.3
Series 2018-B1, Class AM	3.88%	01/15/2051	6,809	6,382,240	0.6
Series 2018-B1, Class XA(d)	0.66%	01/15/2051	29,314	402,646	0.0
Series 2018-B2, Class AS	4.08%	02/15/2051	2,500	2,373,419	0.2
CCUBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2017-C1, Class A4	3.54%	11/15/2050	2,000	1,902,546	0.2
Series 2017-C1, Class XA(d)	1.16%	11/15/2050	11,899	282,912	0.0
CFCRE Commercial Mortgage Trust,					
Series 2016-C6, Class A3	3.22%	11/10/2049	2,000	1,920,610	0.2
Citigroup Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-GC29, Class XA(d)	1.15%	04/10/2048	6,079	15,934	0.0
Series 2016-P6, Class AS	4.03%	12/10/2049	3,360	3,031,001	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2017-C4, Class A4	3.47%	10/12/2050	USD 3,960	\$ 3,812,871	0.3%
Series 2017-P8, Class XA(d)	1.01%	09/15/2050	41,833	828,275	0.1
Series 2018-C6, Class XA(d)	0.93%	11/10/2051	7,413	201,922	0.0
Commercial Mortgage Trust					
Series 2010-C1, Class D	5.99%	07/10/2046	1,824	1,705,981	0.1
Series 2010-C1, Class F	4.00%	07/10/2046	3,780	3,288,400	0.3
Series 2012-CR3, Class E	4.43%	10/15/2045	2,173	1,192,690	0.1
Series 2013-LC6, Class D	4.07%	01/10/2046	190	176,827	0.0
Series 2014-CR16, Class D	4.95%	04/10/2047	1,841	1,509,629	0.1
Series 2014-CR20, Class XA(d)	0.89%	11/10/2047	3,863	90	0.0
Series 2014-LC17, Class B	4.49%	10/10/2047	2,000	1,994,333	0.2
Series 2014-UBS2, Class D	4.99%	03/10/2047	1,250	975,012	0.1
Series 2014-UBS6, Class AM	4.05%	12/10/2047	190	186,866	0.0
Series 2015-CR22, Class XA(d)	0.95%	03/10/2048	12,975	8,712	0.0
Series 2015-LC19, Class XA(d)	1.20%	02/10/2048	36,604	11,486	0.0
Series 2016-DC2, Class XA(d)	1.07%	02/10/2049	42,388	360,477	0.0
CSAIL Commercial Mortgage Trust,					
Series 2017-C8, Class XA(d)	1.21%	06/15/2050	50,695	1,146,384	0.1
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2011-GC5, Class C	5.30%	08/10/2044	4,850	3,738,801	0.3
Series 2011-GC5, Class D	5.30%	08/10/2044	493	254,404	0.0
Series 2013-GC13, Class C	4.00%	07/10/2046	4,537	3,760,305	0.3
Series 2013-GC13, Class D	4.00%	07/10/2046	2,190	1,389,635	0.1
Series 2014-GC22, Class A5	3.86%	06/10/2047	615	588,065	0.1
Series 2014-GC22, Class XA(d)	0.77%	06/10/2047	1,326	26	0.0
Series 2016-GS3, Class A4	2.85%	10/10/2049	2,500	2,391,882	0.2
Series 2017-GS5, Class XA(d)	0.97%	03/10/2050	50,049	828,425	0.1
Series 2017-GS6, Class AS	3.64%	05/10/2050	2,000	1,841,164	0.2
Series 2017-GS7, Class XA(d)	1.22%	08/10/2050	25,477	605,652	0.1
Series 2017-GS8, Class XA(d)	1.07%	11/10/2050	33,703	776,749	0.1
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2012-C6, Class E	5.13%	05/15/2045	3,250	2,931,099	0.3
Series 2012-C6, Class G	2.97%	05/15/2045	2,500	1,945,558	0.2
Series 2013-C10, Class D	4.21%	12/15/2047	1,550	1,395,000	0.1
Series 2016-JP2, Class XA(d)	1.94%	08/15/2049	33,601	745,056	0.1
Series 2016-JP3, Class B	3.40%	08/15/2049	2,000	1,754,753	0.2
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2013-C14, Class D	4.17%	08/15/2046	3,425	2,470,872	0.2
Series 2014-C22, Class XA(d)	0.67%	09/15/2047	10,695	148	0.0
Series 2014-C24, Class C	4.59%	11/15/2047	6,000	4,860,229	0.4
LCCM, Series 2017-LC26, Class XA(d)	1.68%	07/12/2050	23,811	742,733	0.1
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust					
Series 2014-C18, Class C	4.54%	10/15/2047	1,333	1,292,682	0.1
Series 2014-C19, Class D	3.25%	12/15/2047	1,225	971,344	0.1
Series 2014-C19, Class XA(d)	1.00%	12/15/2047	16,761	478	0.0
Series 2015-C20, Class XA(d)	1.33%	02/15/2048	42,300	69,343	0.0
Series 2015-C22, Class XA(d)	1.11%	04/15/2048	41,911	58,671	0.0
Series 2015-C25, Class XA(d)	1.18%	10/15/2048	27,216	152,161	0.0
Series 2017-C34, Class XA(d)	0.91%	11/15/2052	29,262	515,325	0.0
Morgan Stanley Capital I Trust					
Series 2016-UBS9, Class XA(d)	1.26%	03/15/2049	53,103	518,161	0.0
Series 2017-H1, Class A4	3.26%	06/15/2050	1,870	1,806,281	0.2
Series 2018-H4, Class XA(d)	0.97%	12/15/2051	34,769	993,665	0.1
UBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2017-C3, Class XA(d)	1.25%	08/15/2050	30,671	670,113	0.1
Series 2017-C4, Class XA(d)	1.24%	10/15/2050	16,895	446,948	0.0
Series 2017-C5, Class XA(d)	1.21%	11/15/2050	30,044	664,840	0.1
Series 2018-C10, Class A4	4.31%	05/15/2051	2,000	1,954,890	0.2
Series 2018-C10, Class XA(d)	1.02%	05/15/2051	70,634	1,888,618	0.2
Series 2018-C11, Class A5	4.24%	06/15/2051	2,000	1,943,213	0.2
Series 2018-C14, Class XA(d)	1.04%	12/15/2051	40,361	1,198,200	0.1
Series 2018-C15, Class XA(d)	1.05%	12/15/2051	18,612	571,386	0.0
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust,					
Series 2013-C6, Class D	4.06%	04/10/2046	3,076	2,651,707	0.2
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-C27, Class XA(d)	0.93%	02/15/2048	100,733	176,474	0.0
Series 2015-C29, Class C	4.36%	06/15/2048	3,852	3,546,028	0.3
Series 2015-C31, Class A3	3.43%	11/15/2048	1,147	1,130,247	0.1
Series 2015-NXS3, Class A4	3.62%	09/15/2057	1,425	1,399,450	0.1
Series 2015-SG1, Class AS	4.05%	09/15/2048	1,313	1,276,281	0.1
Series 2016-C32, Class XA(d)	1.36%	01/15/2059	50,463	606,144	0.1
Series 2016-C33, Class XA(d)	1.72%	03/15/2059	32,485	542,912	0.0
Series 2016-C35, Class B	3.44%	07/15/2048	2,500	2,373,944	0.2
Series 2016-C36, Class XA(d)	1.30%	11/15/2059	42,382	767,418	0.1

AB FCP I
Mortgage Income Portfolio

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2016-LC25, Class AS(b)	4.01%	12/15/2059	USD 2,216	\$ 2,131,799	0.2%
Series 2017-C38, Class XA(d)	1.06%	07/15/2050	26,854	528,407	0.0
Series 2018-C43, Class A4	4.01%	03/15/2051	5,750	5,589,927	0.5
Series 2018-C46, Class AS	4.38%	08/15/2051	4,500	4,297,911	0.4
Series 2018-C47, Class A4	4.44%	09/15/2061	5,000	4,943,311	0.4
Series 2018-C48, Class XA(d)	1.10%	01/15/2052	41,453	1,358,513	0.1
WFRBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2011-C4, Class E	4.56%	06/15/2044	713	577,530	0.0
Series 2012-C10, Class B	3.74%	12/15/2045	1,448	1,303,145	0.1
Series 2013-C14, Class B(a)	3.84%	06/15/2046	3,706	3,251,848	0.3
Series 2014-C22, Class XA(d)	0.74%	09/15/2057	9,962	158	0.0
Series 2014-C24, Class AS	3.93%	11/15/2047	3,164	3,067,610	0.3
Series 2014-C25, Class D	3.80%	11/15/2047	1,290	1,164,786	0.1
Series 2014-C25, Class XA(d)	0.95%	11/15/2047	10,811	231	0.0
				<u>150,022,351</u>	<u>13.0</u>
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS					
Ashford Hospitality Trust, Series 2018-KEYS, Class A(a)	6.63%	06/15/2035	187	185,569	0.0
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2017-SCH, Class AF(a)	6.38%	11/15/2033	3,000	2,995,450	0.3
BHMS, Series 2018-ATLS, Class A(a)	6.88%	07/15/2035	3,000	2,999,045	0.3
Braemar Hotels & Resorts Trust, Series 2018-PRME, Class A(a)	6.33%	06/15/2035	132	131,804	0.0
BX Commercial Mortgage Trust, Series 2024-BIO2, Class A(b)	5.59%	08/13/2041	6,143	6,206,892	0.5
Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured Credit Risk, Series 2021-MN1, Class M2(a)	9.10%	01/25/2051	1,700	1,723,295	0.2
FS Rialto Issuer LLC, Series 2022-FL4, Class A(a)	7.25%	01/19/2039	3,600	3,590,276	0.3
HGI CRE CLO Ltd., Series 2022-FL3, Class A(a)	7.05%	04/20/2037	4,607	4,599,084	0.4
RIAL Issuer Ltd., Series 2022-FL8, Class A(a)	7.59%	01/19/2037	3,000	2,999,982	0.3
				<u>25,431,397</u>	<u>2.3</u>
				<u>175,453,748</u>	<u>15.3</u>
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2018	4.00%	10/01/2048	3,967	3,826,295	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2024	5.50%	02/01/2054	13,875	13,988,321	1.2
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2024	5.50%	03/01/2054	4,496	4,531,353	0.4
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2024	6.00%	03/01/2054	9,411	9,582,219	0.9
Federal National Mortgage Association, Series 2000	7.50%	10/01/2030	1	839	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.50%	06/01/2031	3	3,532	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.50%	06/01/2031	17	17,781	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2003	5.00%	11/01/2033	98	99,122	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2004	8.00%	09/01/2033	204	212,903	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2008	5.00%	07/01/2037	103	104,014	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2008	5.50%	05/01/2038	143	147,969	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2009	5.00%	05/01/2039	52	52,502	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	02/01/2040	351	357,748	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	04/01/2040	547	558,264	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2010	5.00%	12/01/2040	504	514,172	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2011	5.00%	04/01/2041	226	230,434	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2014	5.00%	08/01/2044	535	547,744	0.1
Government National Mortgage Association, Series 2009	5.00%	10/15/2039	108	109,331	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2012	5.50%	06/15/2038	34	35,387	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2014	5.00%	08/20/2041	185	187,564	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2024, TBA	5.00%	09/01/2054	18,000	17,961,959	1.6
Government National Mortgage Association, Series 2024, TBA	5.50%	09/01/2054	25,000	25,159,915	2.2
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2024, TBA	4.50%	09/01/2054	8,000	7,785,313	0.7
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2024, TBA	5.00%	09/01/2054	5,000	4,963,477	0.4
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2024, TBA	5.50%	09/01/2054	12,500	12,585,449	1.1
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2024, TBA	6.00%	09/01/2054	40,000	40,735,936	3.6
				<u>144,299,543</u>	<u>12.7</u>
AGENCY FIXED RATE 15-YEAR					
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2011	5.00%	07/01/2025	0*	102	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2012	5.00%	06/01/2026	0*	7	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold, Series 2014	3.50%	02/01/2029	231	227,375	0.0
				<u>227,484</u>	<u>0.0</u>
				<u>144,527,027</u>	<u>12.7</u>
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
Pagaya AI Debt, Series 2024-S1, Class D	13.49%	09/15/2031	4,500	4,500,000	0.4
SLM Private Credit Student Loan Trust Series 2003-A, Class A3(e)	0.00%	06/15/2032	2,256	2,222,354	0.2

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Series 2003-A, Class A4(a)	0.00%	06/15/2032	USD 2,198	\$ 2,203,213	0.2%
Series 2003-B, Class A3	2.81%	03/15/2033	1,269	1,271,055	0.1
Series 2003-B, Class A4	0.00%	03/15/2033	850	851,487	0.1
TGIF Funding LLC, Series 2017-1A, Class A2	6.20%	04/30/2047	1,213	1,184,682	0.1
				<u>12,232,791</u>	<u>1.1</u>
SONSTIGE ABS – VARIABEL VERZINSLICH					
Pagaya AI Debt, Series 2024-S1, Class ABC(b)	7.20%	09/15/2031	8,385	8,385,386	0.7
AUTOS – FESTVERZINSLICH					
Octane Receivables Trust, Series 2022-1A, Class D	5.54%	02/20/2029	3,708	3,693,196	0.3
				<u>24,311,373</u>	<u>2.1</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Hertz Corp. (The)	5.00%	12/01/2029	2,500	1,677,771	0.2
FINANZINSTITUTE					
FINANZEN					
Enova International, Inc.	9.13%	08/01/2029	1,086	1,102,479	0.1
				<u>2,780,250</u>	<u>0.3</u>
				<u>1,077,054,649</u>	<u>94.4</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I					
Series 2019-24, Class PT.	0.50%	08/15/2044	6	4,415	0.0
Series 2019-44, Class PT.	6.26%	11/15/2044	28	25,449	0.0
Consumer Loan Underlying Bond Club Certificate Issuer Trust I,					
Series 2019-48, Class PT.	11.86%	12/15/2044	29	26,603	0.0
SMB Private Education Loan Trust					
Series 2021-A, Class R(f)	0.00%	01/15/2053	2	3,821,233	0.3
Series 2021-C, Class R(f)	0.00%	01/15/2053	14	7,290,000	0.7
Series 2022-A, Class R(f)	0.00%	11/16/2054	3	3,095,222	0.3
				<u>14,262,922</u>	<u>1.3</u>
AUTOS – FESTVERZINSLICH					
Octane Receivables Trust					
Series 2020-1A, Class R1(f)	0.00%	03/20/2028	9	350,943	0.0
Series 2021-1A, Class R1(f)	0.00%	11/20/2028	5	670,582	0.1
Santander Consumer Auto Receivables Trust,					
Series 2021-BA, Class R(f)	0.00%	03/15/2029	5	1,193,114	0.1
				<u>2,214,639</u>	<u>0.2</u>
				<u>16,477,561</u>	<u>1.5</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
Grantor Trust COMM (f)	0.00%	03/10/2047	14	0	0.0
Grantor Trust CSAIL (f)	4.00%	04/15/2050	226	2,107,019	0.2
Grantor Trust JPMBB (f)	4.00%	11/15/2047	210	1,428,870	0.1
Grantor Trust WFRBS (f)	3.40%	10/15/2057	217	1,913,292	0.2
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust,					
Series 2014-C20, Class XA(d)	0.70%	07/15/2047	1,833	2	0.0
				<u>5,449,183</u>	<u>0.5</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH					
Towd Point Mortgage Trust, Series 2017-6, Class B5(a)	3.37%	10/25/2057	6,545	3,013,788	0.3
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
FINANZEN					
Curo SPV LLC(f)	18.00%	08/02/2027	2,541	2,640,532	0.2
STAMMAKTIEN					
Curo Group Holdings LLC(f)			236,092	1,101,309	0.1
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Virgolino de Oliveira Finance SA(f) (g)	10.88%	01/13/2020	USD 1,665	166	0.0
				<u>28,682,539</u>	<u>2.6</u>

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Gesamtanlagen				
(Kosten \$1,234,416,756)			\$ 1,105,737,188	97.0%
Termineinlagen				
BNP Paribas, Paris(h)	1.71 %	–	80,038	0.0
DNB, Oslo(h)	2.62 %	–	17	0.0
DNB, Oslo(h)	3.05 %	–	384	0.0
HSBC, Singapore(h)	2.11 %	–	14	0.0
JPMorgan Chase, New York(h)	4.68 %	–	113,985,502	10.0
SMBC, London(h)	4.68 %	–	4,453,951	0.4
SMBC, Tokyo(h)	4.68 %	–	23,433,102	2.1
Standard Chartered Bank, Johannesburg(h)	6.46 %	–	17,460	0.0
Termineinlagen insgesamt			<u>141,970,468</u>	<u>12.5</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			<u>(107,471,289)</u>	<u>(9.5)</u>
Nettovermögen			<u>\$ 1,140,236,367</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	704	USD 99	09/09/2024 \$ (537)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	20	USD 22	09/09/2024 83
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	481	USD 525	09/09/2024 (6,067)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	2,286	CNH 16,379	09/09/2024 26,677
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	10,876	EUR 9,947	09/09/2024 121,502
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	213	EUR 191	09/09/2024 (1,883)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD	104	USD 71	09/23/2024 289
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD	1	USD 0**	09/23/2024 (1)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	20	USD 22	09/23/2024 83
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	27,999	AUD 41,523	09/23/2024 119,541
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	125	AUD 184	09/23/2024 (281)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	10,556	EUR 9,499	09/23/2024 (47,337)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	42	GBP 32	09/23/2024 345
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	3,352	SGD 4,373	09/23/2024 2,543
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	5	SGD 6	09/23/2024 (10)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	14,471	ZAR 258,801	09/23/2024 22,736
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	763	ZAR 13,544	09/23/2024 (4,991)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR	3,082	USD 174	09/23/2024 1,048
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR	18,368	USD 1,028	09/23/2024 (878)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	2,180	CNH 15,460	09/30/2024 8,582
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	10,387	EUR 9,295	09/30/2024 (100,380)
				<u>\$ 141,064</u>
			Wertsteigerung	\$ 303,429
			Wertminderung	\$ (162,365)

+ Zur Absicherung des Portfolios oder der Anteilklassen.

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nomineller Betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 10,450	03/08/2026	1 Day SOFR	4.469%	\$ 81,611
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 44,090	03/11/2026	1 Day SOFR	4.429%	322,019
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 11,890	07/29/2026	1 Day SOFR	4.282%	112,524
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 30,020	08/01/2026	1 Day SOFR	4.223%	255,619
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 29,610	08/08/2026	1 Day SOFR	3.793%	21,269
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 1,726	03/16/2028	1 Day SOFR	3.583%	5,170
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 3,040	01/29/2029	3.752%	1 Day SOFR	(38,257)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 4,180	03/08/2029	1 Day SOFR	3.882%	77,037
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 1,960	03/27/2029	4.008%	1 Day SOFR	(47,052)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 2,120	05/09/2029	4.233%	1 Day SOFR	(73,056)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 17,460	08/30/2029	1 Day SOFR	3.344%	(59,449)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 1,950	01/29/2034	3.752%	1 Day SOFR	(47,353)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 2,040	02/26/2034	3.962%	1 Day SOFR	(84,291)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 1,070	03/27/2034	3.893%	1 Day SOFR	(38,439)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 1,680	04/19/2034	4.203%	1 Day SOFR	(103,159)

Clearing-Broker/(Börse)	Nomineller Betrag (000)	Abschlussdatum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 3,800	05/31/2034	4.247%	1 Day SOFR	\$ (249,340)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 9,450	08/30/2034	1 Day SOFR	3.376%	(59,653)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 580	01/29/2044	3.806%	1 Day SOFR	(22,590)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 610	02/26/2044	3.925%	1 Day SOFR	(33,997)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 700	05/09/2044	4.029%	1 Day SOFR	(49,650)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 3,830	06/04/2044	4.087%	1 Day SOFR	(304,083)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 1,410	05/23/2054	3.809%	1 Day SOFR	(109,708)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 1,590	08/13/2054	3.381%	1 Day SOFR	1,338
Insgesamt					\$ (443,490)
				Wertsteigerung	\$ 876,587
				Wertminderung	\$ (1,320,077)

* Kapitalbetrag geringer als 500.

** Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

(a) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 30. August 2024.

(b) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 30. August 2024.

(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) Zahlungen in Sachwerten (PIK).

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

(g) Not leidendes fälliges Wertpapier.

(h) 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

CLO – Collateralized Loan Obligations

CMBS – Commercial Mortgage-Backed Securities

CME – Chicago Mercantile Exchange

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit

REMICS – Real Estate Mortgage Investment Conduits

SOFR – Secured Overnight Financing Rate

SPI – Share Price Index

TBA – To Be Announced

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

ZUSAMMENSETZUNG DES FONDSVERMÖGENS

31. August 2024

AB FCPI

	Global Equity Blend Portfolio (USD)	Emerging Markets Growth Portfolio (USD)	Asia Ex-Japan Equity Portfolio (USD)
VERMÖGENSWERTE			
Anlagen in Wertpapiere zum Wert	\$ 97,665,816	\$ 531,351,946	\$ 377,756,008
Dividenden- und Zinsforderungen	116,954	767,395	335,997
Termineinlagen	1,975,685	10,002,176	3,612,613
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital	14,382	280,195	1,587,143
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren	-0-	-0-	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften	178,315	11,294	240,332
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps	-0-	-0-	-0-
Zinsforderungen aus Swaps	-0-	-0-	-0-
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel	79,601	3,016,374	2,027,282
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten	-0-	-0-	-0-
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren	1,593,523	-0-	102,087
Forderungen aus der Wertpapierleihe	87	100	-0-
Sonstige Forderungen	4,654	-0-	-0-
	<u>101,629,017</u>	<u>545,429,480</u>	<u>385,661,462</u>
VERBINDLICHKEITEN			
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar	185,047	-0-	-0-
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere	821,812	581,192	299,578
Zu zahlende Dividenden	-0-	2,720	480,068
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften	149,980	7,555	3,018
Zinsaufwand für Swaps	-0-	-0-	-0-
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital	137,656	905,483	370,546
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten	-0-	-0-	-0-
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps	-0-	-0-	-0-
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren	-0-	-0-	-0-
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten	229,566	1,017,695	2,092,719
	<u>1,524,061</u>	<u>2,514,645</u>	<u>3,245,929</u>
NETTOVERMÖGEN	<u>\$ 100,104,956</u>	<u>\$ 542,914,835</u>	<u>\$ 382,415,533</u>

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

Japan Strategic Value Portfolio (JPY)	Short Duration Bond Portfolio (USD)	Global High Yield Portfolio (USD)	American Income Portfolio (USD)	European Income Portfolio (EUR)	Emerging Markets Debt Portfolio (USD)	Mortgage Income Portfolio (USD)
¥ 8,180,045,112	\$ 457,619,445	\$ 15,919,733,621	\$ 26,659,604,877	€ 1,228,646,948	\$ 464,051,448	\$ 1,105,737,188
5,894,394	4,827,826	231,677,929	329,474,921	22,162,128	7,739,989	5,850,666
125,674,963	10,454,374	194,972,667	151,446,030	9,580,721	7,455,409	141,970,468
1,847,234	1,174,553	83,843,245	301,148,581	4,291,118	1,901,373	8,901,070
-0-	-0-	95,549,151	75,285,182	-0-	-0-	-0-
5,435,097	1,493,549	36,769,662	105,154,993	13,577,392	2,372,085	303,429
-0-	-0-	10,969,839	143,611,965	-0-	-0-	876,587
-0-	866	14,601,761	110,553,804	-0-	75,287	2,051,416
-0-	1,371,143	101,086,017	98,969	1,970,930	3,315,649	2,700,862
-0-	87,678	4,412,874	14,082,735	3,362,410	-0-	-0-
-0-	-0-	3,413,222	108,479	499,374	-0-	641,708
128,777	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
659,062	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	56,490
<u>8,319,684,639</u>	<u>477,029,434</u>	<u>16,697,029,988</u>	<u>27,890,570,536</u>	<u>1,284,091,021</u>	<u>486,911,240</u>	<u>1,269,089,884</u>
59,450	676,086	242,411,474	280,867,137	607,845	722,334	2,298,523
-0-	20,059,188	33,956,326	204,430,818	73,389	-0-	116,130,332
7,139,027	589,234	105,025,740	117,237,691	6,156,478	1,593,514	3,464,911
450,938	1,362,753	49,225,279	99,496,436	5,605,945	508,242	162,365
-0-	297	-0-	105,453,111	142,198	199,408	2,266,928
18,611,715	580,537	23,464,424	56,261,735	2,231,000	384,348	2,167,490
-0-	94,378	2,119,437	31,315,923	33,470	333,195	-0-
-0-	9,812	1,893,956	24,182,309	22,751	164,923	1,320,077
-0-	-0-	1,197,343	-0-	1,194,378	933,963	361
<u>16,273,082</u>	<u>489,962</u>	<u>23,769,424</u>	<u>30,886,263</u>	<u>1,448,786</u>	<u>521,933</u>	<u>1,042,530</u>
<u>42,534,212</u>	<u>23,862,247</u>	<u>483,063,403</u>	<u>950,131,423</u>	<u>17,516,240</u>	<u>5,361,860</u>	<u>128,853,517</u>
<u>¥ 8,277,150,427</u>	<u>\$ 453,167,187</u>	<u>\$ 16,213,966,585</u>	<u>\$ 26,940,439,113</u>	<u>€ 1,266,574,781</u>	<u>\$ 481,549,380</u>	<u>\$ 1,140,236,367</u>

ZUSAMMENSETZUNG DES FONDSVERMÖGENS (Fortsetzung)

31. August 2024

AB FCPI

	Kombiniert (USD)
VERMÖGENSWERTE	
Anlagen in Wertpapiere zum Wert	\$ 46,977,634,175*
Dividenden- und Zinsforderungen	605,024,805*
Termineinlagen	533,334,541
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital	403,606,505
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren	170,834,333
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften	161,569,067
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps	155,458,391
Zinsforderungen aus Swaps	127,283,134
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel	115,874,563
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten	22,300,095
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren	6,411,027
Forderungen aus der Wertpapierleihe	1,063
Sonstige Forderungen	65,625
	<u>49,279,397,324*</u>
VERBINDLICHKEITEN	
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar	527,832,917
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere	376,360,370
Zu zahlende Dividenden	234,942,824*
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften	157,115,506
Zinsaufwand für Swaps	108,076,930
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital	86,864,926
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten	33,899,931
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps	27,596,226
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren	3,451,932
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten	61,762,237
	<u>1,617,903,799*</u>
NETTOVERMÖGEN	<u>\$ 47,661,493,525*</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 Jahresabschluss.

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND VERÄNDERUNG DES FONDSVERMÖGENS
Für das Geschäftsjahr zum 31. August 2024

AB FCPI

	Dynamic Diversified Portfolio (USD) (a)	Global Equity Blend Portfolio (USD)	Emerging Markets Growth Portfolio (USD)
ANLAGEERTRÄGE			
Zinsen	\$ 43,316	\$ 99,028	\$ 693,099
Swap-Erträge	918	-0-	-0-
Dividenden, netto	8,755	1,242,369	9,704,088
Erträge auf aus Wertpapierleihe, netto	-0-	8,646	52,775
	<u>52,989</u>	<u>1,350,043</u>	<u>10,449,962</u>
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgebühr	14,887	762,260	8,720,755
Aufwendungen für Swaps	144	-0-	-0-
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	1,066	29,913	481,513
Vertriebsgebühr	320	4,105	8,356
Transferstelle	1,119	37,445	265,186
Steuern	-0-	26,672	299,853
Depotbankgebühren	-0-	26,113	233,010
Gebühr für professionelle Dienstleistungen	15,000	67,126	170,178
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr	1,216	34,806	88,531
Druckkosten	-0-	4,579	12,596
Sonstige Aufwendungen	1,121	23,600	90,620
	<u>34,873</u>	<u>1,016,619</u>	<u>10,370,598</u>
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen	<u>(11,516)</u>	<u>(74,042)</u>	<u>-0-</u>
Nettoaufwendungen	23,357	942,577	10,370,598
Netto-Anlageertrag	<u>29,632</u>	<u>407,466</u>	<u>79,364</u>
REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen	744,601	3,079,506	(23,488,688)
Kapitalertragsteuer	-0-	(42,487)	(2,433)
ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen	(815,454)	12,124,924	85,307,074
Aus Finanzterminkontrakten	(199,501)	-0-	-0-
Aus Devisentermingeschäften	(15,163)	(106,819)	45,252
Aus Swaps	(6,836)	-0-	-0-
Auf Fremdwährung	<u>(4,579)</u>	<u>1,911</u>	<u>131,929</u>
Ergebnis der Geschäftstätigkeit	(267,300)	15,464,501	62,072,498
EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN			
Steigerung/(Minderung)	(24,623,806)	(10,357,002)	(122,910,120)
Ausschüttungen	-0-	-0-	(35,093)
NETTOVERMÖGEN			
Zu Beginn des Geschäftsjahres	24,891,106	94,997,457	603,787,550
Anpassung aus Währungsumrechnung	-0-	-0-	-0-
Am Ende des Geschäftsjahres	<u>\$ -0-</u>	<u>\$ 100,104,956</u>	<u>\$ 542,914,835</u>

(a) Die Finanzinformationen für das Dynamic Diversified Portfolio beziehen sich auf den Zeitraum vom 1. September 2023 bis zum 19. September 2023. Siehe Erläuterung A.

(b) Die Finanzinformationen für das China Low Volatility Equity Portfolio beziehen sich auf den Zeitraum vom 1. September 2023 bis zum 8. März 2024. Siehe Erläuterung A.

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

Asia Ex-Japan Equity Portfolio (USD)	Japan Strategic Value Portfolio (JPY)	China Low Volatility Equity Portfolio (USD) (b)	Short Duration Bond Portfolio (USD)	Global High Yield Portfolio (USD)	American Income Portfolio (USD)	European Income Portfolio (EUR)
\$ 187,578	¥ 3,733,452	\$ 161,896	\$ 20,277,825	\$ 1,063,561,953	\$ 1,354,515,916	€ 65,345,593
-0-	-0-	-0-	604,464	78,076,041	224,958,838	595,646
10,041,924	152,160,717	771,534	-0-	33,438,578	34,542,027	101,956
105	4,105,687	177	-0-	-0-	-0-	-0-
10,229,607	159,999,856	933,607	20,882,289	1,175,076,572	1,614,016,781	66,043,195
3,699,495	66,810,523	630,071	2,626,945	195,190,340	231,838,659	10,356,107
-0-	-0-	-0-	613,042	13,736,882	147,517,339	1,884,572
112,253	2,204,999	17,598	358,296	12,909,435	20,875,723	963,001
77,367	-0-	1,841	-0-	10,178,912	14,297,720	4,571
175,121	4,517,670	40,909	240,571	9,588,144	11,538,058	472,502
116,900	993,662	18,246	177,970	5,859,760	10,796,439	476,172
193,837	6,211,595	30,942	167,988	769,768	1,297,895	186,028
170,049	13,483,674	39,509	188,026	692,109	868,929	236,446
66,807	4,245,671	18,231	39,496	212,500	212,500	140,431
17,847	1,983,665	1,981	-0-	161,341	285,016	37,253
77,234	6,992,007	28,189	79,581	757,554	1,033,617	135,760
4,706,910	107,443,466	827,517	4,491,915	250,056,745	440,561,895	14,892,843
(832)	(27,240,273)	(75,114)	(76,679)	-0-	(17)	-0-
4,706,078	80,203,193	752,403	4,415,236	250,056,745	440,561,878	14,892,843
5,523,529	79,796,663	181,204	16,467,053	925,019,827	1,173,454,903	51,150,352
3,194,164	1,030,924,550	(17,944,336)	(24,211,332)	(187,380,532)	(309,531,380)	(40,587,977)
(1,887,733)	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
53,830,300	106,102,784	12,759,807	32,125,097	1,074,334,021	1,279,433,346	88,324,620
-0-	-0-	-0-	(262,036)	619,281	(57,186,705)	4,341,621
412,277	(12,435,874)	(11,182)	2,002,322	(14,538,450)	2,326,679	3,291,489
-0-	-0-	-0-	571,894	(12,893,553)	124,416,111	494,381
21,743	48,663	1,915	(127,159)	6,393,284	51,754	26,747
61,094,280	1,204,436,786	(5,012,592)	26,565,839	1,791,553,878	2,212,964,708	107,041,233
6,268,072	(193,559,331)	(114,871,025)	(104,466,847)	1,981,473,769	5,052,611,254	86,457,721
(6,048,455)	(75,022,398)	(810,321)	(7,388,697)	(1,148,843,795)	(1,225,131,826)	(48,696,549)
321,101,636	7,341,295,370	120,693,938	538,456,892	13,589,782,733	20,899,994,977	1,121,772,376
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
\$ 382,415,533	¥ 8,277,150,427	\$ -0-	\$ 453,167,187	\$ 16,213,966,585	\$ 26,940,439,113	€ 1,266,574,781

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND VERÄNDERUNG DES FONDSVERMÖGENS

(Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 31. August 2024

AB FCPI

	Emerging Markets Debt Portfolio (USD)	Mortgage Income Portfolio (USD)	Kombiniert (USD)
ANLAGEERTRÄGE			
Zinsen	\$ 38,631,214	\$ 80,483,041	\$ 2,629,305,024
Swap-Erträge	1,133,249	6,956,387	312,373,671
Dividenden, netto	-0-	1,381,433	88,585,525*
Erträge auf aus Wertpapierleihe, netto	-0-	-0-	88,801
	<u>39,764,463</u>	<u>88,820,861</u>	<u>3,030,353,021*</u>
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgebühr	3,485,149	7,438,573	466,040,964
Aufwendungen für Swaps	1,381,940	5,930,543	171,216,735
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	171,941	374,216	36,387,319
Vertriebsgebühr	79,093	1,010	24,653,664
Transferstelle	285,410	466,121	23,178,581
Steuern	174,820	391,668	18,383,533
Depotbankgebühren	109,541	112,035	3,183,185
Gebühr für professionelle Dienstleistungen	170,213	162,825	2,888,507
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr	77,938	119,716	1,051,540
Druckkosten	8,518	12,339	557,572
Sonstige Aufwendungen	60,421	82,347	2,427,161
	<u>6,004,984</u>	<u>15,091,393</u>	<u>749,968,761</u>
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen	-0-	(1,398)	(419,384)
Nettoaufwendungen	6,004,984	15,089,995	749,549,377
Netto-Anlageertrag	<u>33,759,479</u>	<u>73,730,866</u>	<u>2,280,803,644*</u>
REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen	(34,254,377)	(2,671,992)	(629,527,749)
Kapitalertragsteuer	(115,873)	-0-	(2,048,526)
ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen	67,723,909	24,428,866	2,733,862,894*
Aus Finanzterminkontrakten	(1,012,648)	-0-	(53,349,185)
Aus Devisentermingeschäften	3,282,720	538,187	(2,588,813)
Aus Swaps	107,332	(2,199,913)	110,529,362
Auf Fremdwährung	514,880	2,705	7,017,612
Ergebnis der Geschäftstätigkeit	<u>70,005,422</u>	<u>93,828,719</u>	<u>4,444,699,239*</u>
EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN			
Steigerung/(Minderung)	(51,109,436)	335,364,037	7,039,544,910
Ausschüttungen	(19,613,065)	(33,671,422)	(2,491,009,415)*
NETTOVERMÖGEN			
Zu Beginn des Geschäftsjahres	482,266,459	744,715,033	38,641,686,390
Anpassung aus Währungsumrechnung	-0-	-0-	26,572,401
Am Ende des Geschäftsjahres	<u>\$ 481,549,380</u>	<u>\$ 1,140,236,367</u>	<u>\$ 47,661,493,525*</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 Jahresabschluss.

UMLAUFENDE ANTEILE
31. August 2024

AB FCPI

KLASSE	Global Equity Blend Portfolio	Emerging Markets Growth Portfolio	Asia Ex-Japan Equity Portfolio
A	403,532	9,686,218	449,433
A AUD H	-0-	123,374	208,115
A EUR	13,332	155,224	2,831,551
A EUR H	186,660	-0-	-0-
A HKD	-0-	6,609	23,077
A PLN H	-0-	32,557	-0-
A SGD	53,733	1,467	-0-
A SGD H	-0-	2,373	4,061
AD	-0-	46,800	1,654,267
AD AUD H	-0-	-0-	1,928,138
AD CAD H	-0-	-0-	457,396
AD EUR	-0-	-0-	44,644
AD EUR H	-0-	-0-	30,132
AD GBP H	-0-	-0-	214,284
AD HKD	-0-	-0-	893,396
AD NZD H	-0-	-0-	459,683
AD ZAR H	-0-	-0-	1,651,626
AY JPY	-0-	-0-	106,242,295
B	15,644	10,175	-0-
B SGD	2,153	-0-	-0-
BY JPY	-0-	-0-	222,411,001
C	103,286	140,593	242
C EUR	155	974	3,459
ED	-0-	20,622	28,735
ED AUD H	-0-	-0-	17,254
I	22,836	353,942	2,000,954
I AUD H	-0-	53,928	-0-
I EUR	18,495	13,544	5,830
I GBP	-0-	-0-	382
N	-0-	7,731	-0-
S	-0-	-0-	530,928
S HKD	363,365	-0-	416,262
S1	253,574	1,038,185	2,386,633
S1 EUR	272	128	311
S1 GBP	277	131	-0-
S1 SGD	1,304,463	-0-	-0-
SD	-0-	-0-	519,257

UMLAUFENDE ANTEILE (Fortsetzung)

31. August 2024

AB FCPI

KLASSE	Japan Strategic Value Portfolio	Short Duration Bond Portfolio	Global High Yield Portfolio
A	42,575	2,513,826	118,684,417
A CZK H	397	-0-	-0-
A EUR	29,347	58,475	834,596
A EUR H	64,541	-0-	-0-
A SGD	4,175	-0-	-0-
A SGD H	3,819	-0-	-0-
A USD	33,642	-0-	-0-
A USD H	87,479	-0-	-0-
A2	-0-	9,670,224	33,774,115
A2 CHF H	-0-	-0-	6,575
A2 EUR	-0-	69,675	774,403
A2 EUR H	-0-	4,793	3,424,403
A2 HKD	-0-	26,089	218,039
A2 PLN H	-0-	-0-	106,047
A2 SGD	-0-	-0-	6,822
A2 SGD H	-0-	53	562,834
AA	-0-	310,642	431,692,370
AA AUD H	-0-	635,255	147,407,394
AA CAD H	-0-	266,656	3,848,459
AA EUR H	-0-	-0-	3,412,576
AA GBP H	-0-	142,503	6,486,755
AA HKD	-0-	298,818	38,977,560
AA NZD H	-0-	-0-	3,561,022
AA RMB H	-0-	-0-	8,911,197
AA SGD H	-0-	24,511	2,631,798
AA ZAR H	-0-	-0-	246,817,569
AD	7,813	-0-	-0-
AD AUD H	184,373	-0-	-0-
AD NZD H	4,787	-0-	-0-
AD USD H	35,729	-0-	-0-
AD ZAR H	33,668	-0-	-0-
AJ	-0-	3,178,902	-0-
AK	-0-	-0-	12,997
AK EUR	-0-	-0-	222,652
AK EUR H	-0-	-0-	3,482
AR EUR H	-0-	-0-	28,154
AT	-0-	3,932,534	1,202,683,134
AT AUD H	-0-	330,664	64,508,317
AT CAD H	-0-	53,187	7,221,266
AT EUR	-0-	68,787	9,173,819
AT EUR H	-0-	9,725	4,591,430
AT GBP H	-0-	86,883	3,646,770
AT HKD	-0-	205,503	82,534,905
AT NZD H	-0-	88,690	10,818,063
AT RMB H	-0-	-0-	2,743,477
AT SGD	-0-	-0-	3,635,582
AT SGD H	-0-	27,337	16,000,296
AX	-0-	16,388	-0-
B	-0-	-0-	758,813
B2	-0-	-0-	2,028
BT	-0-	-0-	280,459
BT AUD H	-0-	-0-	12,484
C	232	170,085	14,799,891
C EUR	100	-0-	44,677
C EUR H	521	-0-	-0-
C USD	500	-0-	-0-
C2	-0-	193,178	858,484
C2 EUR	-0-	-0-	8,043

KLASSE	Japan Strategic Value Portfolio	Short Duration Bond Portfolio	Global High Yield Portfolio
C2 EUR H	-0-	-0-	9,191
CT	-0-	-0-	19,083
EA	-0-	-0-	257,870,187
EA AUD H	-0-	-0-	17,034,816
EA ZAR H	-0-	-0-	32,132,526
I	5,359	759,011	14,980,246
I EUR	2,165	-0-	86,808
I EUR H	367	-0-	-0-
I USD	30,576	-0-	-0-
I USD H	14,082	-0-	-0-
I2	-0-	637,005	7,543,902
I2 AUD H	-0-	-0-	4,448
I2 CHF H	-0-	-0-	2,993
I2 EUR	-0-	-0-	32,923
I2 EUR H	-0-	1,697,639	289,340
I2 SGD	-0-	-0-	31,721
I2 SGD H	-0-	-0-	28,547
IA AUD H	-0-	-0-	143,122
IQD	-0-	-0-	20,184
IT	-0-	76,298	2,897,659
IT AUD H	-0-	-0-	789,803
IT CAD H	-0-	-0-	30,605
IT EUR H	-0-	-0-	20,086
IT GBP H	-0-	-0-	18,272
IT HKD	-0-	-0-	69,274
IT RMB H	-0-	-0-	12,387
J	-0-	-0-	4,546,793
N2	-0-	307,775	431,244
NT	-0-	26,082	1,555,929
S	-0-	951,529	-0-
S1	-0-	-0-	11,705,026
S1 2	-0-	1,078,039	-0-
S1 2 EUR	-0-	567	-0-
S1 EUR	74	-0-	-0-
S1 EUR H	-0-	90	400
S1 USD	146,483	-0-	-0-
S1D	-0-	-0-	29,278,305
S1D2	-0-	-0-	187,130
S1L GBP H	-0-	-0-	789
S1T	-0-	118,231	-0-
SA	-0-	32,101	312,229
SD	65,121	-0-	-0-
SHK	-0-	-0-	157,380
SK	-0-	-0-	16,907,905
W	-0-	-0-	28,480
W EUR	-0-	-0-	830
W2	-0-	-0-	76,238
W2 CHF H	-0-	-0-	7,008
W2 EUR H	-0-	-0-	13,542
WT	-0-	-0-	120,709
WT AUD H	-0-	-0-	119,458
WT CAD H	-0-	-0-	39,670
WT EUR H	-0-	-0-	42,513
WT GBP H	-0-	-0-	3,839
WT RMB H	-0-	-0-	8,508

UMLAUFENDE ANTEILE (Fortsetzung)

31. August 2024

AB FCPI

KLASSE	American Income Portfolio	European Income Portfolio	Emerging Markets Debt Portfolio
A	164,369,785	1,764,633	821,327
A EUR	635,544	-0-	607
A USD	-0-	361,831	-0-
A2	60,568,274	2,431,523	327,683
A2 CHF H	308,824	4,045	729
A2 DUR PH	729	-0-	-0-
A2 EUR	1,175,788	-0-	125,835
A2 EUR H	1,628,776	-0-	16,929
A2 HKD	1,303,506	-0-	7,512
A2 PLN H	889,453	134,303	18,990
A2 SGD	16,686	-0-	-0-
A2 SGD H	1,242,798	-0-	243,550
A2 USD	-0-	349,677	-0-
A2 USD H	-0-	352,613	-0-
AA	201,058,090	2,072,230	4,033,279
AA AUD H	54,773,342	9,985,890	2,424,656
AA CAD H	9,321,659	-0-	5,154
AA DUR PH	478,275	-0-	-0-
AA EUR H	3,780,628	-0-	1,293
AA GBP H	12,826,702	-0-	29,654
AA HKD	108,246,004	-0-	150,754
AA HKD H	-0-	4,895,677	-0-
AA NZD H	8,504,560	-0-	44,729
AA RMB H	22,693,177	811,930	-0-
AA SGD H	3,208,446	76,094	-0-
AA USD H	-0-	40,450,901	-0-
AA ZAR H	26,583,448	-0-	7,023,942
AI	-0-	-0-	161,311
AI AUD H	-0-	-0-	5,859
AK	27,128	232,798	-0-
AK EUR	31,877	-0-	-0-
AK EUR H	14,618	-0-	-0-
AR	-0-	2,938,849	-0-
AR EUR	4,712	-0-	1,050
AR EUR H	161,998	-0-	-0-
AT	993,515,254	13,443,843	5,202,888
AT AUD H	112,697,386	3,437,155	3,771,578
AT CAD H	35,552,519	-0-	126,139
AT DUR PH	38,141	-0-	-0-
AT EUR	5,114,247	-0-	38,041
AT EUR H	14,287,212	-0-	169,576
AT GBP H	25,061,675	-0-	30,114
AT HKD	398,597,606	-0-	419,914
AT NZD H	19,884,279	-0-	407,965
AT RMB H	10,863,109	-0-	-0-
AT SGD	3,522,650	-0-	-0-
AT SGD H	46,179,565	487,685	186,285
AT USD	-0-	474,530	-0-
AT USD H	-0-	9,069,489	-0-
B	505,751	-0-	-0-
B USD	-0-	107,069	-0-
B2	33,947	680	-0-
B2 USD	-0-	1,300	-0-
BT	549,614	-0-	18,790
C	18,071,672	634,886	145,721
C EUR	25,219	-0-	616
C USD	-0-	83,297	-0-
C2	4,894,545	385,022	72,572
C2 EUR	65,379	-0-	547

KLASSE	American Income Portfolio	European Income Portfolio	Emerging Markets Debt Portfolio
C2 EUR H	5,787	-0-	541
C2 USD	-0-	9,837	-0-
C2 USD H	-0-	76,590	-0-
CK	-0-	210,611	-0-
CT	166,899	-0-	1,207
CT USD H	-0-	32,634	-0-
EA	227,207,057	-0-	382,770
EA AUD H	15,966,958	-0-	230,117
EA ZAR H	12,099,310	-0-	302,998
EI	-0-	-0-	54,280
EI AUD H	-0-	-0-	10,333
I	51,512,426	2,018,713	164,518
I EUR	149,566	-0-	-0-
I USD	-0-	334,812	-0-
I2	40,736,977	7,558,064	43,249
I2 AUD H	3,339,487	138,269	168,467
I2 CHF H	160,642	633	600
I2 EUR	460,888	-0-	128,923
I2 EUR H	1,507,865	-0-	3,074,950
I2 HKD	585	-0-	-0-
I2 SGD H	381,508	-0-	-0-
I2 USD	-0-	210,303	-0-
I2 USD H	-0-	121,493	-0-
IA	322,579	71,091	-0-
IA AUD H	2,408,627	-0-	-0-
IA HKD H	-0-	1,346	-0-
IA USD H	-0-	1,195	-0-
IT	19,214,624	208,352	-0-
IT AUD H	336,660	-0-	1,439
IT CAD H	492,397	-0-	-0-
IT EUR H	109,551	-0-	1,333,333
IT GBP H	371,410	-0-	-0-
IT HKD	705,564	-0-	-0-
IT JPY	321,016	-0-	-0-
IT JPY H	328,322	-0-	-0-
IT NZD H	79,027	-0-	-0-
IT RMB H	241,214	-0-	-0-
IT SGD H	3,692,822	-0-	-0-
IT USD H	-0-	143,219	-0-
J	147,159,662	-0-	-0-
N2	3,871,364	-0-	9,695
NT	3,504,228	-0-	70,472
NT USD H	-0-	55,008	-0-
S	1,188,575	-0-	107,328
S1	53,024,663	329,269	-0-
S1 2	-0-	-0-	2,828,899
S1 EUR H	-0-	-0-	521
S1 GBP H	-0-	-0-	431
S1 USD	-0-	349	-0-
S1 USD H	-0-	5,605,877	-0-
S1D	29,079,602	239,072	-0-
S1D2	1,910,325	-0-	-0-
S1L	-0-	-0-	13,186
SA	4,581,368	-0-	873,532
SA USD H	-0-	1,041,749	-0-
SHK	3,344,618	73,508	-0-
W	3,352,978	-0-	-0-
W2	4,381,212	143,298	-0-
W2 CHF H	107,902	25,287	-0-

UMLAUFENDE ANTEILE (Fortsetzung)
31. August 2024

AB FCPI

	American Income Portfolio	European Income Portfolio	Emerging Markets Debt Portfolio
KLASSE			
W2 EUR H	112,850	-0-	-0-
W2 USD H	-0-	5,667	-0-
WA	-0-	406,616	-0-
WA USD H	-0-	286,920	-0-
WT	7,359,418	59,579	-0-
WT AUD H	1,629,441	-0-	-0-
WT EUR H	525,212	-0-	-0-
WT GBP H	400,371	-0-	-0-
WT HKD	963,057	-0-	-0-
WT SGD H	1,915,338	-0-	-0-
WT USD H	-0-	4,261	-0-
			Mortgage Income Portfolio
KLASSE			
A			9,785,728
A2			8,015,699
A2 EUR			126,031
A2 EUR H			14,109
A2 HKD			8,033
A2X			146,158
A2X EUR			25,977
AA			10,899,966
AA AUD H			3,876,524
AA HKD			5,176,650
AA RMB H			464,970
AA SGD H			387,145
AA ZAR H			3,743,214
AR EUR H			25,987
AT			3,972,785
AT AUD H			276,113
AT EUR			23,499
AT GBP H			2,668
AT HKD			257,022
AT SGD H			52,665
AX			477,521
AX EUR			4,652
BX			35,863
BX EUR			3,298
C			1,198,871
C2			989,641
C2 EUR			507
CX			18,443
I			4,941,260
I EUR			3,381
I2			10,318,813
I2 EUR			79,158
I2 EUR H			1,667,318
IT EUR H			1,894
IX			91,410
N2			502,845
NT			856,032
S			1,404
S1			8,615,636
S1 AUD H			14,527
S1 EUR H			90
S1L			14,699
SA			320,268

	Dynamic Diversified Portfolio (1)		
	19. September 2023	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	\$ 6,785,711	\$ 24,891,106	\$ 35,394,677
Klasse			
A.....	\$ 20.75	\$ 21.04	\$ 20.28
A EUR.....	€ 19.43	€ 19.41	€ 20.18
A EUR H.....	€ 17.26	€ 17.52	€ 17.41
AX.....	\$ 25.04	\$ 25.39	\$ 24.45
AX EUR.....	€ 23.44	€ 23.41	€ 24.33
AX SGD.....	SGD 34.18	SGD 34.33	SGD 34.20
BX.....	\$ 20.75	\$ 21.06	\$ 20.49
BX SGD.....	N/A	N/A	SGD 28.69
C.....	\$ 20.09	\$ 20.38	\$ 19.70
C EUR.....	€ 18.81	€ 18.79	€ 19.60
C EUR H.....	€ 16.70	€ 16.96	€ 16.89
CX.....	\$ 23.78	\$ 24.12	\$ 23.30
I.....	\$ 22.46	\$ 22.77	\$ 21.79
I EUR.....	€ 21.02	€ 20.99	€ 21.68
I EUR H (2).....	N/A	€ 18.95	€ 18.71
IX (3).....	N/A	\$ 28.71	\$ 27.46

	Global Equity Blend Portfolio		
	31. August 2024	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	\$ 100,104,956	\$ 94,997,457	\$ 92,151,147
Klasse			
A.....	\$ 29.62	\$ 25.44	\$ 23.07
A EUR.....	€ 26.79	€ 23.46	€ 22.96
A EUR H.....	€ 24.59	€ 21.55	€ 20.21
A SGD.....	SGD 38.69	SGD 34.41	SGD 32.27
B.....	\$ 24.01	\$ 20.83	\$ 19.08
B SGD.....	SGD 31.37	SGD 28.18	SGD 26.69
C.....	\$ 27.24	\$ 23.50	\$ 21.41
C EUR.....	€ 15.70	€ 13.79	€ 13.54
I.....	\$ 35.15	\$ 29.94	\$ 26.94
I EUR.....	€ 31.79	€ 27.61	€ 26.80
S HKD.....	HKD 343.91	HKD 291.30	HKD 259.26
S1.....	\$ 38.70	\$ 32.82	\$ 29.40
S1 EUR.....	€ 35.01	€ 30.27	€ 29.25
S1 GBP.....	£ 29.48	£ 25.92	£ 25.31
S1 SGD.....	SGD 50.55	SGD 44.40	SGD 41.12

	Emerging Markets Growth Portfolio		
	31. August 2024	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	\$ 542,914,835	\$ 603,787,550	\$ 546,098,583
Klasse			
A.....	\$ 45.70	\$ 41.22	\$ 42.46
A AUD H.....	AUD 18.75	AUD 17.24	AUD 18.31
A EUR.....	€ 41.33	€ 38.00	€ 42.24
A HKD.....	HKD 356.45	HKD 323.30	HKD 333.27
A PLN H.....	PLN 104.48	PLN 94.33	PLN 94.78
A SGD.....	SGD 59.70	SGD 55.76	SGD 59.38
A SGD H.....	SGD 14.96	SGD 13.76	SGD 14.42
AD.....	\$ 15.74	\$ 14.75	\$ 15.78
B.....	\$ 33.47	\$ 30.48	\$ 31.72

Emerging Markets Growth Portfolio (Fortsetzung)			
	31. August 2024	31. August 2023	31. August 2022
C.....	\$ 37.09	\$ 33.60	\$ 34.77
C EUR.....	€ 33.56	€ 30.99	€ 34.59
ED.....	\$ 11.32	\$ 10.60	\$ 11.34
I.....	\$ 56.96	\$ 50.95	\$ 52.07
I AUD H.....	AUD 20.82	AUD 18.98	AUD 19.98
I EUR.....	€ 51.53	€ 46.99	€ 51.80
N.....	\$ 22.21	\$ 20.12	\$ 20.81
S1.....	\$ 59.56	\$ 53.19	\$ 54.26
S1 EUR.....	€ 53.96	€ 49.12	€ 54.03
S1 GBP.....	£ 45.45	£ 42.07	£ 46.77

Asia Ex-Japan Equity Portfolio			
	31. August 2024	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	\$ 382,415,533	\$ 321,101,636	\$ 495,340,478
Klasse			
A.....	\$ 25.60	\$ 21.56	\$ 21.89
A AUD H.....	AUD 24.17	AUD 20.67	AUD 21.66
A EUR.....	€ 23.15	€ 19.87	€ 21.77
A HKD.....	HKD 199.66	HKD 169.06	HKD 171.82
A SGD H.....	SGD 17.69	SGD 15.16	SGD 15.69
AD.....	\$ 14.83	\$ 12.99	\$ 13.74
AD AUD H.....	AUD 12.34	AUD 10.86	AUD 11.75
AD CAD H.....	CAD 10.68	CAD 9.38	CAD 10.04
AD EUR.....	€ 13.57	€ 12.07	€ 13.71
AD EUR H.....	€ 13.24	€ 11.63	€ 12.46
AD GBP H.....	£ 13.15	£ 11.55	£ 12.39
AD HKD.....	HKD 115.76	HKD 101.92	HKD 107.91
AD NZD H.....	NZD 13.49	NZD 11.88	NZD 12.84
AD RMB H (4).....	N/A	CNH 79.22	CNH 85.40
AD ZAR H.....	R 95.68	R 84.28	R 90.69
AY JPY.....	¥ 2.70	¥ 2.26	¥ 2.19
BD.....	N/A	N/A	\$ 13.65
BD AUD H.....	N/A	N/A	AUD 11.74
BD HKD.....	N/A	N/A	HKD 107.18
BY JPY.....	¥ 2.54	¥ 2.14	¥ 2.08
C.....	\$ 23.95	\$ 20.26	\$ 20.67
C EUR.....	€ 21.69	€ 18.67	€ 20.57
ED.....	\$ 12.81	\$ 11.18	\$ 11.79
ED AUD H.....	AUD 14.78	AUD 12.97	AUD 13.98
I.....	\$ 28.83	\$ 24.08	\$ 24.25
I AUD H (5).....	N/A	AUD 23.42	AUD 24.34
I EUR.....	€ 26.06	€ 22.19	€ 24.13
I GBP.....	£ 24.65	£ 21.34	£ 23.45
S.....	\$ 33.79	\$ 27.93	\$ 27.85
S HKD.....	HKD 263.53	HKD 219.06	HKD 218.61
S1.....	\$ 29.53	\$ 24.63	\$ 24.78
S1 EUR.....	€ 26.73	€ 22.72	€ 24.66
SD.....	\$ 101.09	\$ 88.86	\$ 94.48

Japan Strategic Value Portfolio			
	31. August 2024	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	¥ 8,277,150,427	¥ 7,341,295,370	¥ 6,696,083,364
Klasse			
A.....	¥ 16,100.00	¥ 14,251.00	¥ 12,031.00
A CZK H.....	CZK 1,514.60	CZK 1,279.17	CZK 1,009.83
A EUR.....	€ 99.75	€ 90.44	€ 86.22
A EUR H.....	€ 38.66	€ 33.37	€ 27.64
A PLN (6).....	N/A	PLN 404.26	PLN 407.17
A SGD.....	SGD 143.78	SGD 132.43	SGD 121.07
A SGD H.....	SGD 24.60	SGD 21.21	SGD 17.29
A USD.....	\$ 110.22	\$ 97.99	\$ 86.63
A USD H.....	\$ 50.04	\$ 42.49	\$ 34.28
AD.....	¥ 15,182.00	¥ 13,728.00	¥ 11,876.00
AD AUD H.....	AUD 19.38	AUD 17.81	AUD 15.49
AD NZD H.....	NZD 20.15	NZD 18.46	NZD 15.97
AD USD H.....	\$ 19.75	\$ 17.98	\$ 15.52
AD ZAR H.....	R 138.73	R 126.43	R 109.05
C.....	¥ 14,642.00	¥ 13,074.00	¥ 11,128.00
C EUR.....	€ 90.76	€ 83.00	€ 79.82
C EUR H.....	€ 35.48	€ 30.90	€ 25.81
C USD.....	\$ 100.21	\$ 89.91	\$ 80.16
I.....	¥ 18,574.00	¥ 16,313.00	¥ 13,666.00
I EUR.....	€ 115.13	€ 103.56	€ 98.03
I EUR H.....	€ 43.25	€ 37.04	€ 30.46
I SGD.....	N/A	N/A	SGD 137.54
I USD.....	\$ 127.18	\$ 112.21	\$ 98.42
I USD H.....	\$ 55.38	\$ 46.65	\$ 37.36
S EUR H (7).....	N/A	€ 37.32	€ 30.46
S1 EUR.....	€ 122.62	€ 110.17	€ 104.16
S1 USD.....	\$ 135.45	\$ 119.39	\$ 104.61
SD.....	¥ 16,695.00	¥ 15,019.00	¥ 12,939.00

China Low Volatility Equity Portfolio (8)			
	8. März 2024	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	\$ 59,873,800	\$ 120,693,938	\$ 121,824,745
Klasse			
A.....	\$ 40.68	\$ 41.95	\$ 47.68
A EUR.....	€ 37.20	€ 38.68	€ 47.44
A HKD.....	HKD 318.20	HKD 328.99	HKD 374.26
A PLN H.....	PLN 70.34	PLN 72.32	PLN 80.57
AD.....	\$ 10.73	\$ 11.33	\$ 13.51
AD AUD H.....	AUD 9.31	AUD 9.85	AUD 12.03
AD CAD H.....	CAD 9.81	CAD 10.36	CAD 12.47
AD EUR H.....	€ 10.10	€ 10.68	€ 12.87
AD GBP H.....	£ 9.92	£ 10.49	£ 12.65
AD HKD.....	HKD 83.98	HKD 88.96	HKD 106.05
AD NZD H.....	NZD 9.59	NZD 10.15	NZD 12.39
AD SGD H.....	SGD 10.01	SGD 10.59	SGD 12.77
AD ZAR H.....	R 62.39	R 65.99	R 80.64
B.....	\$ 31.25	\$ 32.39	\$ 37.19
B EUR.....	€ 28.57	€ 29.87	€ 37.00
BD NZD H.....	N/A	N/A	NZD 12.46

China Low Volatility Equity Portfolio (8) (Fortsetzung)

	8. März 2024	31. August 2023	31. August 2022
C.....	\$ 37.68	\$ 38.94	\$ 44.46
C EUR.....	€ 34.44	€ 35.91	€ 44.24
I.....	\$ 50.08	\$ 51.41	\$ 57.96
I EUR.....	€ 45.77	€ 47.40	€ 57.67
S (9).....	N/A	\$ 65.80	\$ 73.44
S1.....	\$ 56.43	\$ 57.85	\$ 65.05
S1 EUR.....	€ 51.61	€ 53.36	€ 64.74

Short Duration Bond Portfolio

	31. August 2024	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	\$ 453,167,187	\$ 538,456,892	\$ 479,574,798
Klasse			
A.....	\$ 7.22	\$ 7.06	\$ 7.13
A EUR.....	€ 6.54	€ 6.52	€ 7.11
A2.....	\$ 19.00	\$ 18.05	\$ 17.74
A2 EUR.....	€ 17.19	€ 16.65	€ 17.66
A2 EUR H.....	€ 14.11	€ 13.63	€ 13.73
A2 HKD.....	HKD 148.19	HKD 141.60	HKD 139.28
A2 SGD H (10).....	SGD 15.55	N/A	N/A
AA.....	\$ 10.56	\$ 10.47	\$ 10.70
AA AUD H.....	AUD 10.32	AUD 10.24	AUD 10.51
AA CAD H.....	CAD 10.57	CAD 10.50	CAD 10.75
AA GBP H.....	£ 10.51	£ 10.44	£ 10.69
AA HKD.....	HKD 82.41	HKD 82.13	HKD 84.03
AA SGD H.....	SGD 10.51	SGD 10.45	SGD 10.71
AJ.....	\$ 6.94	\$ 6.79	\$ 6.86
AT.....	\$ 7.21	\$ 7.05	\$ 7.12
AT AUD H.....	AUD 11.14	AUD 10.92	AUD 11.07
AT CAD H.....	CAD 11.36	CAD 11.13	CAD 11.26
AT EUR.....	€ 6.53	€ 6.52	€ 7.11
AT EUR H.....	€ 10.97	€ 10.76	€ 10.89
AT GBP H.....	£ 11.40	£ 11.19	£ 11.32
AT HKD.....	HKD 56.27	HKD 55.38	HKD 55.98
AT NZD H.....	NZD 11.53	NZD 11.31	NZD 11.44
AT SGD H.....	SGD 11.69	SGD 11.48	SGD 11.62
AX.....	\$ 5.77	\$ 5.65	\$ 5.70
B.....	N/A	N/A	\$ 7.14
C.....	\$ 7.22	\$ 7.07	\$ 7.14
C2.....	\$ 15.47	\$ 14.75	\$ 14.56
C2 EUR H (11).....	N/A	€ 12.84	€ 12.98
I.....	\$ 7.22	\$ 7.07	\$ 7.14
I EUR (12).....	N/A	€ 6.52	€ 7.12
I2.....	\$ 13.97	\$ 13.20	\$ 12.90
I2 EUR (13).....	N/A	€ 12.17	€ 12.83
I2 EUR H.....	€ 15.28	€ 14.67	€ 14.70
IT.....	\$ 11.85	\$ 11.60	\$ 11.72
N2.....	\$ 14.94	\$ 14.27	\$ 14.09
NT.....	\$ 11.69	\$ 11.45	\$ 11.56
S.....	\$ 93.70	\$ 91.73	\$ 92.67
S1 2.....	\$ 17.81	\$ 16.79	\$ 16.36
S1 2 EUR.....	€ 16.12	€ 15.48	€ 16.28
S1 EUR H.....	€ 104.71	€ 100.33	N/A
S1T **.....	\$ 102.43	\$ 100.27	N/A
SA.....	\$ 81.09	\$ 79.47	\$ 80.36

	Global High Yield Portfolio		
	31. August 2024	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	\$ 16,213,966,585	\$ 13,589,782,733	\$ 14,421,357,362
Klasse			
A.....	\$ 3.20	\$ 3.06	\$ 3.09
A EUR.....	€ 2.93	€ 2.85	€ 3.08
A2.....	\$ 18.18	\$ 16.18	\$ 15.12
A2 CHF H.....	CHF 15.56	CHF 14.46	CHF 14.11
A2 EUR.....	€ 16.44	€ 14.92	€ 15.04
A2 EUR H.....	€ 24.45	€ 22.17	€ 21.32
A2 HKD.....	HKD 141.77	HKD 126.89	HKD 118.67
A2 PLN H.....	PLN 118.31	PLN 105.04	PLN 95.78
A2 SGD.....	SGD 23.74	SGD 21.88	SGD 21.14
A2 SGD H.....	SGD 22.84	SGD 20.71	SGD 19.62
AA.....	\$ 8.12	\$ 8.00	\$ 8.28
AA AUD H.....	AUD 7.50	AUD 7.43	AUD 7.76
AA CAD H.....	CAD 7.64	CAD 7.56	CAD 7.87
AA EUR H.....	€ 7.76	€ 7.68	€ 8.00
AA GBP H.....	£ 7.57	£ 7.51	£ 7.83
AA HKD.....	HKD 63.40	HKD 62.81	HKD 65.01
AA NZD H.....	NZD 7.62	NZD 7.54	NZD 7.85
AA RMB H.....	CNH 52.53	CNH 52.01	CNH 54.32
AA SGD H.....	SGD 7.85	SGD 7.77	SGD 8.09
AA ZAR H.....	R 51.91	R 51.28	R 53.40
AK.....	\$ 10.34	\$ 9.92	\$ 10.01
AK EUR.....	€ 9.48	€ 9.23	€ 10.01
AK EUR H.....	€ 10.06	€ 9.68	€ 9.84
AR EUR H.....	€ 8.13	€ 8.09	€ 8.50
AT.....	\$ 3.17	\$ 3.03	\$ 3.05
AT AUD H.....	AUD 10.42	AUD 10.02	AUD 10.20
AT CAD H.....	CAD 9.60	CAD 9.23	CAD 9.35
AT EUR.....	€ 2.90	€ 2.82	€ 3.05
AT EUR H.....	€ 10.67	€ 10.26	€ 10.41
AT GBP H.....	£ 10.54	£ 10.15	£ 10.31
AT HKD.....	HKD 24.72	HKD 23.80	HKD 23.99
AT NZD H.....	NZD 9.66	NZD 9.28	NZD 9.42
AT RMB H.....	CNH 69.46	CNH 66.84	CNH 67.98
AT SGD.....	SGD 4.14	SGD 4.11	SGD 4.28
AT SGD H.....	SGD 9.75	SGD 9.39	SGD 9.52
B.....	\$ 3.22	\$ 3.07	\$ 3.09
B2.....	\$ 25.25	\$ 22.70	\$ 21.42
BA.....	N/A	N/A	\$ 7.54
BA AUD H.....	N/A	N/A	AUD 7.05
BT.....	\$ 3.25	\$ 3.10	\$ 3.12
BT AUD H.....	AUD 10.49	AUD 10.07	AUD 10.22
BT HKD.....	N/A	N/A	HKD 24.48
BT NZD H.....	N/A	N/A	NZD 9.56
C.....	\$ 3.21	\$ 3.07	\$ 3.09
C EUR.....	€ 2.93	€ 2.85	€ 3.08
C2.....	\$ 25.19	\$ 22.53	\$ 21.15
C2 EUR.....	€ 22.78	€ 20.77	€ 21.05
C2 EUR H.....	€ 19.01	€ 17.33	€ 16.75
CK (14).....	N/A	\$ 9.91	\$ 9.99

Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)

	31. August 2024	31. August 2023	31. August 2022
CK EUR H (15)	N/A	€ 9.70	€ 9.85
CT	\$ 10.80	\$ 10.33	\$ 10.39
EA	\$ 9.64	\$ 9.56	\$ 9.95
EA AUD H	AUD 9.80	AUD 9.77	AUD 10.26
EA ZAR H	R 66.79	R 66.44	R 69.54
I	\$ 3.19	\$ 3.06	\$ 3.09
I EUR	€ 2.93	€ 2.85	€ 3.08
I2	\$ 11.80	\$ 10.44	\$ 9.71
I2 AUD H	AUD 30.34	AUD 27.29	AUD 25.89
I2 CHF H	CHF 16.35	CHF 15.12	CHF 14.66
I2 EUR	€ 10.67	€ 9.63	€ 9.66
I2 EUR H	€ 26.32	€ 23.75	€ 22.72
I2 SGD	SGD 15.40	SGD 14.13	SGD 13.58
I2 SGD H	SGD 20.07	SGD 18.11	SGD 17.06
IA AUD H	AUD 9.67	AUD 9.52	AUD 9.90
IQD	\$ 10.17	\$ 9.73	\$ 9.80
IQD EUR	N/A	N/A	€ 9.82
IT	\$ 9.92	\$ 9.51	\$ 9.59
IT AUD H	AUD 9.23	AUD 8.88	AUD 9.05
IT CAD H	CAD 11.41	CAD 10.98	CAD 11.14
IT EUR H	€ 10.55	€ 10.16	€ 10.32
IT GBP H	£ 11.30	£ 10.88	£ 11.07
IT HKD	HKD 77.42	HKD 74.61	HKD 75.28
IT RMB H	CNH 66.17	CNH 63.72	CNH 64.89
J	\$ 3.46	\$ 3.31	\$ 3.32
N2	\$ 20.72	\$ 18.54	\$ 17.42
NT	\$ 10.23	\$ 9.78	\$ 9.84
S1	\$ 31.88	\$ 28.17	\$ 26.14
S1 EUR (16)	N/A	€ 25.99	€ 26.02
S1 EUR H	€ 111.57	€ 100.43	N/A
S1D	\$ 16.35	\$ 15.24	\$ 14.96
S1D2	\$ 108.01	\$ 103.33	N/A
S1L GBP H	£ 107.84	£ 101.57	N/A
SA	\$ 65.65	\$ 63.41	\$ 64.44
SHK	\$ 72.64	\$ 70.16	\$ 71.27
SK	\$ 43.14	\$ 38.03	\$ 35.21
W	\$ 12.04	\$ 11.53	\$ 11.63
W EUR	€ 11.04	€ 10.73	€ 11.61
W2	\$ 18.31	\$ 16.19	\$ 15.03
W2 CHF H	CHF 14.95	CHF 13.81	CHF 13.38
W2 EUR H	€ 15.90	€ 14.32	€ 13.68
WT	\$ 10.94	\$ 10.48	\$ 10.57
WT AUD H	AUD 10.27	AUD 9.88	AUD 10.06
WT CAD H	CAD 11.60	CAD 11.15	CAD 11.31
WT EUR H	€ 10.60	€ 10.21	€ 10.36
WT GBP H	£ 11.43	£ 11.02	£ 11.21
WT RMB H	CNH 78.13	CNH 75.23	CNH 76.63

	American Income Portfolio		
	31. August 2024	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	\$ 26,940,439,113	\$ 20,899,994,977	\$ 16,566,716,085
Klasse			
A.....	\$ 6.58	\$ 6.39	\$ 6.69
A EUR.....	€ 6.06	€ 5.96	€ 6.68
A2.....	\$ 31.72	\$ 28.98	\$ 28.52
A2 CHF H.....	CHF 14.88	CHF 14.22	CHF 14.64
A2 DUR PH.....	\$ 21.46	\$ 19.67	\$ 17.99
A2 EUR.....	€ 28.69	€ 26.72	€ 28.37
A2 EUR H.....	€ 18.49	€ 17.22	€ 17.47
A2 HKD.....	HKD 247.33	HKD 227.27	HKD 223.83
A2 PLN H.....	PLN 111.28	PLN 101.52	PLN 97.57
A2 SGD.....	SGD 41.42	SGD 39.19	SGD 39.88
A2 SGD H.....	SGD 20.82	SGD 19.38	SGD 19.33
AA.....	\$ 9.69	\$ 9.55	\$ 10.14
AA AUD H.....	AUD 9.16	AUD 9.07	AUD 9.73
AA CAD H.....	CAD 9.17	CAD 9.07	CAD 9.68
AA DUR PH.....	\$ 10.69	\$ 10.52	\$ 10.34
AA EUR H.....	€ 9.15	€ 9.07	€ 9.70
AA GBP H.....	£ 9.02	£ 8.95	£ 9.58
AA HKD.....	HKD 75.51	HKD 74.91	HKD 79.60
AA NZD H.....	NZD 9.13	NZD 9.04	NZD 9.67
AA RMB H.....	CNH 62.20	CNH 61.63	CNH 66.07
AA SGD H.....	SGD 9.35	SGD 9.26	SGD 9.89
AA ZAR H.....	R 63.42	R 62.67	R 66.91
AK.....	\$ 10.90	\$ 10.59	\$ 11.10
AK EUR.....	€ 10.08	€ 9.92	€ 11.13
AK EUR H.....	€ 10.62	€ 10.37	€ 10.96
AR EUR.....	€ 9.83	€ 9.91	€ 11.38
AR EUR H.....	€ 9.31	€ 9.25	€ 9.95
AT.....	\$ 6.57	\$ 6.38	\$ 6.68
AT AUD H.....	AUD 10.71	AUD 10.45	AUD 11.04
AT CAD H.....	CAD 10.74	CAD 10.47	CAD 11.01
AT DUR PH.....	\$ 12.64	\$ 12.18	\$ 11.74
AT EUR.....	€ 6.05	€ 5.96	€ 6.68
AT EUR H.....	€ 10.71	€ 10.45	€ 11.02
AT GBP H.....	£ 10.58	£ 10.34	£ 10.91
AT HKD.....	HKD 51.30	HKD 50.11	HKD 52.44
AT NZD H.....	NZD 10.23	NZD 9.98	NZD 10.52
AT RMB H.....	CNH 72.46	CNH 70.77	CNH 74.80
AT SGD.....	SGD 8.59	SGD 8.65	SGD 9.35
AT SGD H.....	SGD 10.81	SGD 10.56	SGD 11.10
B.....	\$ 6.61	\$ 6.41	\$ 6.69
B2.....	\$ 24.67	\$ 22.70	\$ 22.50
B2 HKD.....	N/A	N/A	HKD 176.60
BA.....	N/A	N/A	\$ 9.51
BA AUD H.....	N/A	N/A	AUD 9.10
BT.....	\$ 6.65	\$ 6.45	\$ 6.74
BT AUD H.....	N/A	N/A	AUD 11.12
BT CAD H.....	N/A	N/A	CAD 10.94
BT EUR H.....	N/A	N/A	€ 11.03
BT GBP H.....	N/A	N/A	£ 11.00
BT HKD.....	N/A	N/A	HKD 52.91
BT NZD H.....	N/A	N/A	NZD 10.59
C.....	\$ 6.60	\$ 6.41	\$ 6.69

American Income Portfolio (Fortsetzung)

	31. August 2024	31. August 2023	31. August 2022
C EUR	€ 6.07	€ 5.98	€ 6.69
C2.....	\$ 38.05	\$ 34.92	\$ 34.52
C2 DUR PH.....	N/A	N/A	\$ 17.25
C2 EUR	€ 34.42	€ 32.20	€ 34.34
C2 EUR H	€ 17.40	€ 16.27	€ 16.58
CT.....	\$ 11.04	\$ 10.71	\$ 11.19
EA	\$ 10.96	\$ 10.86	\$ 11.59
EA AUD H.....	AUD 10.47	AUD 10.42	AUD 11.23
EA ZAR H.....	R 72.13	R 71.63	R 76.85
I	\$ 6.56	\$ 6.38	\$ 6.69
I EUR.....	€ 6.05	€ 5.96	€ 6.68
I2	\$ 19.25	\$ 17.49	\$ 17.12
I2 AUD H.....	AUD 16.26	AUD 15.01	AUD 14.97
I2 CHF H	CHF 15.88	CHF 15.08	CHF 15.44
I2 DUR PH (17).....	N/A	\$ 20.56	\$ 18.70
I2 EUR.....	€ 17.41	€ 16.13	€ 17.03
I2 EUR H	€ 20.37	€ 18.86	€ 19.03
I2 HKD.....	HKD 150.32	HKD 137.34	HKD 134.36
I2 SGD (18).....	N/A	SGD 23.67	SGD 23.95
I2 SGD H.....	SGD 18.94	SGD 17.54	SGD 17.39
IA	\$ 11.27	\$ 11.05	\$ 11.66
IA AUD H	AUD 10.72	AUD 10.55	AUD 11.25
IT	\$ 10.68	\$ 10.40	\$ 10.90
IT AUD H.....	AUD 9.98	AUD 9.75	AUD 10.32
IT CAD H.....	CAD 11.68	CAD 11.40	CAD 12.01
IT EUR H.....	€ 11.61	€ 11.36	€ 12.00
IT GBP H.....	£ 11.51	£ 11.27	£ 11.91
IT HKD	HKD 83.42	HKD 81.64	HKD 85.57
IT JPY	¥ 11,186.00	¥ 10,600.00	¥ 10,425.00
IT JPY H	¥ 6,736.00	¥ 6,609.00	¥ 7,002.00
IT NZD H.....	NZD 11.55	NZD 11.30	NZD 11.94
IT RMB H	CNH 78.60	CNH 76.90	CNH 81.38
IT SGD (19).....	N/A	N/A	SGD 15.26
IT SGD H.....	SGD 10.89	SGD 10.65	SGD 11.23
J	\$ 6.74	\$ 6.54	\$ 6.82
L2 (20).....	N/A	\$ 14.38	\$ 14.12
LT (21).....	N/A	\$ 11.52	\$ 12.06
N2.....	\$ 18.41	\$ 16.91	\$ 16.73
NT	\$ 10.73	\$ 10.41	\$ 10.88
S.....	\$ 22.73	\$ 20.50	\$ 19.92
S1	\$ 25.04	\$ 22.70	\$ 22.16
S1 EUR	N/A	N/A	€ 22.05
S1D	\$ 13.83	\$ 13.25	\$ 13.66
S1D2	\$ 77.42	\$ 75.41	\$ 79.07
SA.....	\$ 73.99	\$ 71.95	\$ 75.39
SHK	\$ 76.94	\$ 74.82	\$ 78.38
W	\$ 11.78	\$ 11.48	\$ 12.03
W2	\$ 17.83	\$ 16.17	\$ 15.80
W2 CHF H.....	CHF 14.51	CHF 13.76	CHF 14.06
W2 EUR H.....	€ 15.34	€ 14.19	€ 14.29
WT.....	\$ 11.79	\$ 11.48	\$ 12.04
WT AUD H	AUD 11.22	AUD 10.98	AUD 11.62
WT EUR H.....	€ 11.67	€ 11.42	€ 12.06
WT GBP H.....	£ 11.49	£ 11.25	£ 11.88
WT HKD	HKD 92.09	HKD 90.15	HKD 94.52
WT SGDH.....	SGD 11.55	SGD 11.31	SGD 11.92

	European Income Portfolio		
	31. August 2024	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen.....	€ 1,266,574,781	€ 1,121,772,376	€ 1,411,076,501
Klasse			
A.....	€ 5.94	€ 5.65	€ 5.76
A USD.....	\$ 6.49	\$ 6.08	\$ 5.77
A2.....	€ 21.47	€ 19.63	€ 19.23
A2 CHF H.....	CHF 15.74	CHF 14.78	CHF 14.70
A2 PLN H.....	PLN 120.24	PLN 107.74	PLN 100.08
A2 USD.....	\$ 23.74	\$ 21.29	\$ 19.33
A2 USD H.....	\$ 20.47	\$ 18.40	\$ 17.53
AA.....	€ 10.49	€ 10.11	€ 10.44
AA AUD H.....	AUD 10.22	AUD 9.85	AUD 10.21
AA HKD H.....	HKD 70.03	HKD 67.44	HKD 69.43
AA RMB H.....	CNH 69.79	CNH 67.29	CNH 69.66
AA SGD H.....	SGD 10.42	SGD 10.05	SGD 10.37
AA USD H.....	\$ 10.72	\$ 10.29	\$ 10.57
AK.....	€ 12.50	€ 11.89	€ 12.12
AR.....	€ 10.32	€ 9.96	€ 10.29
AT.....	€ 5.94	€ 5.65	€ 5.76
AT AUD H.....	AUD 12.63	AUD 12.02	AUD 12.29
AT SGD H.....	SGD 12.10	SGD 11.53	SGD 11.75
AT USD.....	\$ 6.50	\$ 6.08	\$ 5.77
AT USD H.....	\$ 13.18	\$ 12.50	\$ 12.67
B USD.....	\$ 6.53	\$ 6.10	\$ 5.78
B2.....	€ 18.03	€ 16.60	€ 16.37
B2 USD.....	\$ 19.92	\$ 17.99	\$ 16.45
BA AUD H.....	N/A	N/A	AUD 9.59
BA USD H.....	N/A	N/A	\$ 9.94
BT.....	N/A	N/A	€ 5.77
BT AUD H.....	N/A	N/A	AUD 12.34
BT USD H.....	N/A	N/A	\$ 12.67
C.....	€ 5.96	€ 5.66	€ 5.77
C USD.....	\$ 6.52	\$ 6.09	\$ 5.78
C2.....	€ 20.03	€ 18.40	€ 18.11
C2 USD.....	\$ 22.15	\$ 19.96	\$ 18.20
C2 USD H.....	\$ 19.27	\$ 17.40	\$ 16.65
CK.....	€ 12.51	€ 11.89	€ 12.12
CT USD H.....	\$ 12.15	\$ 11.52	\$ 11.67
I.....	€ 5.93	€ 5.65	€ 5.76
I USD.....	\$ 6.46	\$ 6.06	\$ 5.77
I2.....	€ 14.63	€ 13.30	€ 12.96
I2 AUD H.....	AUD 32.05	AUD 29.06	AUD 28.05
I2 CHF H.....	CHF 16.31	CHF 15.23	CHF 15.06
I2 USD.....	\$ 16.17	\$ 14.43	\$ 13.03
I2 USD H.....	\$ 29.62	\$ 26.48	\$ 25.09
IA.....	€ 11.71	€ 11.22	€ 11.52
IA HKD H.....	HKD 78.84	HKD 75.47	HKD 77.21
IA SGD H (22).....	N/A	SGD 11.23	SGD 11.52
IA USD H.....	\$ 11.95	\$ 11.40	\$ 11.72
IT.....	€ 12.56	€ 11.95	€ 12.19
IT SGD H (23).....	N/A	SGD 11.98	SGD 12.21
IT USD H.....	\$ 12.50	\$ 11.85	\$ 12.02

Emerging Markets Debt Portfolio (Fortsetzung)

	31. August 2024	31. August 2023	31. August 2022
AT NZD H	NZD 8.68	NZD 8.09	NZD 8.28
AT SGD H	SGD 9.75	SGD 9.10	SGD 9.27
B2 HKD	N/A	N/A	HKD 184.66
BT	\$ 11.34	\$ 10.48	\$ 10.56
C	\$ 11.26	\$ 10.44	\$ 10.54
C EUR	€ 10.37	€ 9.74	€ 10.53
C2	\$ 30.93	\$ 27.05	\$ 25.73
C2 EUR	€ 27.99	€ 24.94	€ 25.60
C2 EUR H	€ 18.21	€ 16.25	€ 15.94
CT	\$ 9.57	\$ 8.87	\$ 8.95
EA	\$ 10.42	\$ 9.87	\$ 10.19
EA AUD H	AUD 9.83	AUD 9.36	AUD 9.77
EA ZAR H	R 67.29	R 63.86	R 66.43
EI	\$ 50.67	\$ 48.19	\$ 51.24
EI AUD H	AUD 49.26	AUD 47.10	AUD 50.69
I	\$ 11.16	\$ 10.38	\$ 10.52
I2	\$ 37.20	\$ 32.21	\$ 30.33
I2 AUD H	AUD 16.48	AUD 14.50	AUD 13.94
I2 CHF H	CHF 14.67	CHF 13.28	CHF 13.06
I2 EUR	€ 33.65	€ 29.70	€ 30.18
I2 EUR H	€ 21.01	€ 18.56	€ 18.03
IT AUD H	AUD 8.69	AUD 8.11	AUD 8.30
IT EUR H	€ 9.65	€ 9.01	€ 9.20
N2	\$ 17.08	\$ 14.95	\$ 14.24
NT	\$ 9.31	\$ 8.62	\$ 8.70
S	\$ 37.48	\$ 32.23	\$ 30.13
S1 2	\$ 34.66	\$ 29.97	\$ 28.18
S1 2 EUR (29)	N/A	€ 27.66	€ 28.06
S1 EUR H	€ 20.41	€ 18.00	€ 17.45
S1 GBP H	£ 22.44	£ 19.52	£ 18.67
S1L	\$ 108.52	\$ 100.49	N/A
SA	\$ 68.81	\$ 63.89	\$ 64.72

Mortgage Income Portfolio

	31. August 2024	31. August 2023	31. August 2022
Nettovermögen	\$ 1,140,236,367	\$ 744,715,033	\$ 829,713,296
Klasse			
A	\$ 11.57	\$ 11.31	\$ 11.22
A2	\$ 21.45	\$ 19.37	\$ 17.83
A2 EUR	€ 19.40	€ 17.86	€ 17.74
A2 EUR H (30)	€ 15.18	N/A	N/A
A2 HKD	HKD 167.25	HKD 151.89	HKD 139.98
A2 SGD (31)	N/A	SGD 26.21	SGD 24.94
A2X	\$ 15.40	\$ 13.89	\$ 12.78
A2X EUR	€ 13.93	€ 12.81	€ 12.71
AA	\$ 9.92	\$ 9.83	\$ 9.89
AA AUD H	AUD 9.51	AUD 9.44	AUD 9.53
AA HKD	HKD 77.36	HKD 77.14	HKD 77.67
AA RMB H	CNH 67.03	CNH 66.68	CNH 67.55
AA SGD H	SGD 9.75	SGD 9.70	SGD 9.78
AA ZAR H	R 66.39	R 65.83	R 66.17

Mortgage Income Portfolio (Fortsetzung)

	31. August 2024	31. August 2023	31. August 2022
AR EUR H	€ 9.57	€ 9.54	€ 9.70
AT	\$ 11.59	\$ 11.33	\$ 11.24
AT AUD H	AUD 11.16	AUD 10.92	AUD 10.87
AT EUR	€ 10.48	€ 10.44	€ 11.23
AT GBP H	£ 12.00	£ 11.77	£ 11.72
AT HKD	HKD 90.39	HKD 88.88	HKD 88.26
AT SGD (32)	N/A	SGD 15.28	SGD 15.73
AT SGD H	SGD 11.38	SGD 11.16	SGD 11.09
AX	\$ 5.60	\$ 5.48	\$ 5.43
AX EUR	€ 5.06	€ 5.04	€ 5.43
BX	\$ 5.61	\$ 5.48	\$ 5.43
BX EUR	€ 5.06	€ 5.04	€ 5.42
C	\$ 11.59	\$ 11.33	\$ 11.23
C2	\$ 20.43	\$ 18.53	\$ 17.13
C2 EUR	€ 18.49	€ 17.09	€ 17.05
CX	\$ 5.60	\$ 5.48	\$ 5.43
I	\$ 11.57	\$ 11.31	\$ 11.22
I EUR	€ 10.45	€ 10.41	€ 11.20
I2	\$ 22.72	\$ 20.40	\$ 18.68
I2 EUR	€ 20.57	€ 18.83	€ 18.59
I2 EUR H	€ 16.79	€ 15.32	€ 14.40
IT EUR H	€ 12.14	€ 11.89	€ 11.83
IX	\$ 5.60	\$ 5.48	\$ 5.43
N2	\$ 17.74	\$ 16.11	\$ 14.91
NT	\$ 12.34	\$ 12.06	\$ 11.96
S	\$ 11.54	\$ 11.28	\$ 11.19
S1	\$ 21.24	\$ 19.04	\$ 17.40
S1 AUD H	AUD 121.17	AUD 109.99	N/A
S1 EUR (33)	N/A	€ 17.57	€ 17.32
S1 EUR H	€ 110.25	€ 100.44	€ 94.16
S1 JPY (34)	N/A	¥ 14,584.00	¥ 12,733.00
SIL	\$ 104.52	\$ 101.43	N/A
SA	\$ 75.53	\$ 73.90	\$ 73.40

** Die Anteilklasse wurde umbenannt. Siehe Anmerkung A.

- (1) Letzte offizielle NIW-Berechnung am 19. September 2023. Siehe Anmerkung A.
- (2) Aufgelöst am 8. September 2023 mit einem abschließenden NAV von €18.74
- (3) Aufgelöst am 18. September 2023 mit einem abschließenden NAV von \$28.43
- (4) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von CNH78.89
- (5) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von AUD23.47
- (6) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von PLN383.99
- (7) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von €37.67
- (8) Letzte offizielle NIW-Berechnung am 8. März 2024. Siehe Anmerkung A.
- (9) Aufgelöst am 15. Dezember 2023 mit einem abschließenden NAV von \$61.65
- (10) Auflegungsdatum 16. Oktober 2023
- (11) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von €12.94
- (12) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von €6.51
- (13) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von €12.25
- (14) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von \$10.03

-
- (15) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von €9.77
 - (16) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von €26.22
 - (17) Aufgelöst am 26. Februar 2024 mit einem abschließenden NAV von \$21.79
 - (18) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von SGD23.51
 - (19) Auflegungsdatum 19. Oktober 2023 und am 29. Mai 2024 liquidiert mit einem abschließenden NAV von SGD15.45
 - (20) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von \$14.42
 - (21) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von \$11.41
 - (22) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von SGD11.29
 - (23) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von SGD12.05
 - (24) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von HKD80.37
 - (25) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von SGD12.30
 - (26) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von PLN118.18
 - (27) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von CHN58.34
 - (28) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von SGD8.11
 - (29) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von €27.72
 - (30) Auflegungsdatum 18. Juni 2024
 - (31) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von SGD26.34
 - (32) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von SGD15.15
 - (33) Aufgelöst am 21. November 2023 mit einem abschließenden NAV von €17.75
 - (34) Aufgelöst am 8. November 2023 mit einem abschließenden NAV von ¥15,264.00

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 12 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.

Das Portfolio AB FCPI – Dynamic Diversified Portfolio wurde aufgelöst. Der letzte offizielle Nettoinventarwert („NIW“) wurde am 19. September 2023 berechnet. Zum 31. August 2024 belief sich der Barsaldo für das Portfolio auf 7,123 USD. Zum Ende des Jahres befanden sich zwei illiquide Wertpapiere in der Verwahrung, die nicht verkauft wurden. Es gibt keine öffentlichen Handelsplätze für den Verkauf der Wertpapiere.

Der Verwaltungsrat hat beschlossen, die Neuklassifizierung der aktuellen Anteilsklasse S1 des AB FCPI – Short Duration Bond Portfolio in die Anteilsklasse S1T zum Stichtag 8. März 2024 zu genehmigen.

Der Verwaltungsrat hat beschlossen, die Übertragung aller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (die „Zusammenlegung“) des AB FCPI – China Low Volatility Equity Portfolio in das AB SICAV I - All China Equity Portfolio zu genehmigen. Die Zusammenlegung erfolgte mit Wirkung zum 8. März 2024 zum Umtauschverhältnis von 1:1, mit Ausnahme der folgenden Anteilsklassen: A, I und S1 mit einem Umtauschverhältnis von 1:3.8669, 1:4.5445 bzw. 1:0.7566.

Die folgende Tabelle zeigt den Beginn der Geschäftstätigkeit der einzelnen Portfolios sowie die zum 31. August 2024 angebotenen Anteilsklassen:

AB FCPI-	Geschäftsaufnahme	Angebote Anteilklassen
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
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 ZAR H, AY JPY, BY JPY, C, C EUR, ED, ED AUD H, I, 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 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 USD, I USD H, S1 EUR, S1 USD & SD
Short Duration Bond Portfolio	13. September 1996	A, A EUR, A2, A2 EUR, A2 EUR H, A2 HKD, A2 SGD H, 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, C, C2, I, I2, I2 EUR H, IT, N2, NT, S, S1 2, S1 2 EUR, S1 EUR H, S1T & SA

AB FCPI-	Geschäftsaufnahme	Angebotene Anteilklassen
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, 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 H, S1D, S1D2, S1L GBP H, 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 EUR, C2 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 HKD, 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 H, J, 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
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 USD H, IT, 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 USD H, WT & WT USD H

AB FCPI-	Geschäftsaufnahme	Angeborene Anteilklassen
Emerging Markets Debt Portfolio.....	22. März 2006	A, A EUR, A2, A2 CHF H, A2 EUR, A2 EUR H, A2 HKD, 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 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 EUR H, S1 GBP H, S1L & SA
Mortgage Income Portfolio.....	26. September 1994	A, A2, A2 EUR, A2 EUR H, A2 HKD, 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 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 H, S1L & SA

ANMERKUNG B: Relevante Bilanzierungsgrundsätze

Der Jahresabschluss wurde im Einklang mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen und behördlichen Vorschriften und nach dem Fortführungsprinzip erstellt, mit Ausnahme des Japan Strategic Value Portfolio, dessen Jahresabschluss auf Basis der Nichtfortführung erstellt wurde, da der Verwaltungsrat beschlossen hat, dieses Portfolio am 19. November 2024 zu auflösen. Folglich wurden die Vermögenswerte des letzteren Portfolios zum geschätzten realisierbaren Wert und die Verbindlichkeiten zum geschätzten Abwicklungsbetrag ausgewiesen. Es folgt eine Zusammenfassung der relevanten Bilanzierungsgrundsätze der Portfeuillees.

1. Valuation**1.1 Investments in Securities**

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 Wertpapieren, 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 verfü-

bar 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 Portfeuillees so berichtigen, dass sie den zum Bewertungszeitpunkt des Portfeuillees als angemessen erachteten Wert jener Wertpapiere widerspiegeln.

Wenn hinsichtlich eines bestimmten Portfeuille-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 Portfeuille-Wertpapiere, die zur Berechnung des Nettoinventarwerts („NAV“) des Portfeuillees 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 Portfeuille-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 Portfeuille-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 verfolgt 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 festgelegt werden, den angemessenen Wert widerspiegelt.

US-Staatspapiere und andere Schuldtitel mit einer Restlaufzeit von 60 Tagen oder weniger werden im Allgemeinen zum Marktpreis von einem unabhängigen Anbieter bewertet, sofern ein Marktpreis verfügbar ist. 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 ursprüngliche 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, Devisenterminkontrakten, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ verbucht. Bei allen anderen Swap-Arten werden die abgeschriebenen Vorabgebühren unter „Realisierte Gewinne und (Verluste) aus Anlagen, Devisenterminkontrakten, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ ausgewiesen. Schwankungen des Werts von Swap-Kontrakten werden als eine Komponente der Änderungen der nicht realisierten 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 gemäss den Verwaltungsbestimmungen in einer anderen Währung als der Währung, auf die ein Portfolio lautet, ausgedrückt werden, werden zum Durchschnitt des letzten verfügbaren Geld- und Briefkurses dieser Währung 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 den 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 Jahresabschluss wurden folgende Kurse zugrunde gelegt: Kassakurs von 1.1054 und Mittelkurs von 1.0808 für die Umrechnung von EUR in USD, Kassakurs von 0.0068 und Mittelkurs von 0.0066 für die Umrechnung von JPY to 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. Anlageerträge 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 Transaktionsstag 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 Jahresabschlusses 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)

Der Fonds hat mit Wirkung zum 2. November 2015 eine NIW-Anpassungsrichtlinie eingeführt, die auch als „Swing Pricing“ bezeichnet wird. 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 Anteilinhaber 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 Anteilinhaber-Investitionen in Anteile eines Portefeuilles, die durch Transaktionen mit Portefeuilleanteilen hervorgerufen wird, minimieren.

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

Alle Portefeuilles, die dem „Swing Pricing“ unterliegen, mit Ausnahme des Dynamic Diversified Portfolio haben im Berichtszeitraum den Swing-Pricing-Mechanismus auf den jeweiligen NAV angewandt, und zum 31. August 2024, hat das folgende Portefeuille den Swing-Pricing-Mechanismus auf den NAV angewandt:

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 Gesamtnettovermögens 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 widergespiegelt.

Für das Dynamic Diversified Portfolio (bis zum Liquidationsdatum):

- 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 Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen 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 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 Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen 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 Nettoerträge, 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 Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen 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 Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen 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 (bis zum Zusammenlegungsdatum):

- 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 Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen 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, C, I und S (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 Portfolios entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AJ, AT, CT, IT, NT und S1T (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 Portfolios 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, S1, S2 und S1 2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) und Anteile der Klassen S EUR H, 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 Portfolios 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 Portfolios 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 Portfolios entsprechen werden, die der jeweiligen Anteil-

klasse zuzuweisen sind. Für Anteile der Klasse SK kann die Verwaltungsgesellschaft nach ihrem Ermessen Dividenden erklären und ausschütten.

- Für Anteile der Klassen AK 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 Klasse S1L (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, eine monatlich Dividende auszuschütten, die in der Regel sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portfolios entspricht, die dieser Anteilklasse zuzurechnen sind. Diese Dividenden werden nicht aus dem der Anteilklasse zuzurechnenden Kapital gezahlt.
- Für Anteile der Klassen A2, B2, C2, E2, 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 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 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, E2, 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 widergespiegelt.

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, E2, 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 widergespiegelt.

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 Klasse S1L beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, eine monatlich Dividende auszuschütten, die in der Regel sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portfolios entspricht, die dieser Anteilklasse zuzurechnen sind. Diese Dividenden werden nicht aus dem der Anteilklasse zuzurechnenden Kapital gezahlt.

- Für Anteile der Klassen A2, C2, E2, 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 Klassen 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 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 S1L beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, eine monatlich Dividende auszuschütten, die in der Regel sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portfolios entspricht, die dieser Anteilklasse zuzurechnen sind. Diese Dividenden werden nicht aus dem der Anteilklasse zuzurechnenden Kapital gezahlt.

- Für Anteile der Klassen A2, A2X, C2, C2X, E2, 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 Managementgebühr. 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(a)	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 C	2.25%
	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(b)	1.25%
	Klasse IX(c)	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%

AB FCPI-	Anteilklasse	%
Global Equity Blend		
Portfolio (Fortsetzung)	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%
Emerging Markets Growth		
Portfolio.....	Klasse S1	1.20%
	Klasse S1 EUR	1.20%
	Klasse S1 GBP	1.20%
Asia Ex-Japan Equity		
Portfolio.....	Klasse A	2.05%
	Klasse A AUD H	2.05%
	Klasse A EUR	2.05%
	Klasse A HKD	2.05%
	Klasse A SGD H	2.05%
	Klasse AD	2.05%
	Klasse AD AUD H	2.05%
	Klasse AD CAD H	2.05%
	Klasse AD EUR	2.05%
	Klasse AD EUR H	2.05%
	Klasse AD GBP H	2.05%
	Klasse AD HKD	2.05%
	Klasse AD NZD H	2.05%
	Klasse AD RMB H(d)	2.05%
	Klasse AD ZAR H	2.05%
	Klasse AY JPY	2.05%
	Klasse BY JPY	2.52%
	Klasse C	2.50%
	Klasse C EUR	2.50%
	Klasse ED	3.05%
	Klasse ED AUD H	3.05%
	Klasse I	1.25%

AB FCPI-	Anteilklasse	%	AB FCPI-	Anteilklasse	%
Asia Ex-Japan Equity			China Low Volatility Equity		
Portfolio (Fortsetzung)	Klasse I AUD H(d)	1.25%	Portfolio(e) (Fortsetzung) . . .	Klasse I EUR	1.19%
	Klasse I EUR	1.25%		Klasse S(f)	0.16%
	Klasse I GBP	1.25%		Klasse S1	0.91%
	Klasse S	0.30%		Klasse S1 EUR	0.91%
	Klasse S HKD	0.30%	Short Duration Bond		
	Klasse S1	1.20%	Portfolio	Klasse A	1.20%
	Klasse S1 EUR	1.20%		Klasse A EUR	1.20%
	Klasse SD	0.30%		Klasse A2	1.20%
Japan Strategic Value				Klasse A2 EUR	1.20%
Portfolio	Klasse A	1.70%		Klasse A2 EUR H	1.20%
	Klasse A CZK H	1.70%		Klasse A2 HKD	1.20%
	Klasse A EUR	1.70%		Klasse A2 SGD H	1.20%
	Klasse A EUR H	1.70%		Klasse AA	1.20%
	Klasse A PLN(d)	1.70%		Klasse AA AUD H	1.20%
	Klasse A SGD	1.70%		Klasse AA CAD H	1.20%
	Klasse A SGD H	1.70%		Klasse AA GBP H	1.20%
	Klasse A USD	1.70%		Klasse AA HKD	1.20%
	Klasse A USD H	1.70%		Klasse AA SGD H	1.20%
	Klasse AD	1.70%		Klasse AJ	1.00%
	Klasse AD AUD H	1.70%		Klasse AT	1.20%
	Klasse AD NZD H	1.70%		Klasse AT AUD H	1.20%
	Klasse AD USD H	1.70%		Klasse AT CAD H	1.20%
	Klasse AD ZAR H	1.70%		Klasse AT EUR	1.20%
	Klasse C	2.60%		Klasse AT EUR H	1.20%
	Klasse C EUR	2.60%		Klasse AT GBP H	1.20%
	Klasse C EUR H	2.60%		Klasse AT HKD	1.20%
	Klasse C USD	2.60%		Klasse AT NZD H	1.20%
	Klasse I	0.90%		Klasse AT SGD H	1.20%
	Klasse I EUR	0.90%		Klasse AX	1.00%
	Klasse I EUR	0.90%		Klasse C	1.60%
	Klasse I EUR H	0.90%		Klasse C2	1.60%
	Klasse I USD	0.90%		Klasse C2 EUR H(d)	1.60%
	Klasse I USD H	0.90%		Klasse I	0.575%
	Klasse S EUR H(d)	0.15%		Klasse I EUR(d)	0.575%
	Klasse S1 EUR	0.80%		Klasse I2	0.575%
	Klasse S1 USD	0.80%		Klasse I2 EUR(d)	0.575%
	Klasse SD	0.15%		Klasse I2 EUR H	0.575%
China Low Volatility Equity				Klasse IT	0.575%
Portfolio(e)	Klasse A	1.99%		Klasse N2	1.70%
	Klasse A EUR	1.99%		Klasse NT	1.70%
	Klasse A HKD	1.99%		Klasse S	0.10%
	Klasse A PLN H	1.99%		Klasse S1 2	0.35%
	Klasse AD	1.99%		Klasse S1 2 EUR	0.35%
	Klasse AD AUD H	1.99%		Klasse S1 EUR H	0.35%
	Klasse AD CAD H	1.99%		Klasse S1T	0.35%
	Klasse AD EUR H	1.99%		Klasse SA	0.10%
	Klasse AD GBP H	1.99%	Global High Yield Portfolio . . .	Klasse S1	1.00%
	Klasse AD HKD	1.99%		Klasse S1 EUR	1.00%
	Klasse AD NZD H	1.99%		Klasse S1 EUR H	1.00%
	Klasse AD SGD H	1.99%		Klasse S1D	1.00%
	Klasse AD ZAR H	1.99%		Klasse S1D2	1.00%
	Klasse B	2.99%		Klasse S1L GBP H	1.00%
	Klasse B EUR	2.99%		Klasse SA	0.10%
	Klasse C	2.44%		Klasse SHK	0.10%
	Klasse C EUR	2.44%		Klasse SK	0.75%
	Klasse I	1.19%			

AB FCPI-	Anteilklasse	%	AB FCPI-	Anteilklasse	%
American Income Portfolio	Klasse A	1.50%	American Income Portfolio	Klasse I2 EUR	0.95%
	Klasse A EUR	1.50%	(Fortsetzung)	Klasse I2 EUR H	0.95%
	Klasse A2	1.50%		Klasse I2 HKD	0.95%
	Klasse A2 CHF H	1.50%		Klasse I2 SGD(d)	0.95%
	Klasse A2 DUR PH	1.50%		Klasse I2 SGD H	0.95%
	Klasse A2 EUR	1.50%		Klasse IA	0.95%
	Klasse A2 EUR H	1.50%		Klasse IA AUD H	0.95%
	Klasse A2 HKD	1.50%		Klasse IT	0.95%
	Klasse A2 PLN H	1.50%		Klasse IT AUD H	0.95%
	Klasse A2 SGD	1.50%		Klasse IT CAD H	0.95%
	Klasse A2 SGD H	1.50%		Klasse IT EUR H	0.95%
	Klasse AA	1.50%		Klasse IT GBP H	0.95%
	Klasse AA AUD H	1.50%		Klasse IT HKD	0.95%
	Klasse AA CAD H	1.50%		Klasse IT JPY	0.95%
	Klasse AA DUR PH	1.50%		Klasse IT JPY H	0.95%
	Klasse AA EUR H	1.50%		Klasse IT NZD H	0.95%
	Klasse AA GBP H	1.50%		Klasse IT RMB H	0.95%
	Klasse AA HKD	1.50%		Klasse IT SGD(h)	0.95%
	Klasse AA NZD H	1.50%		Klasse IT SGD H	0.95%
	Klasse AA RMB H	1.50%		Klasse L2(d)	1.05%
	Klasse AA SGD H	1.50%		Klasse LT(d)	1.05%
	Klasse AA ZAR H	1.50%		Klasse N2	2.05%
	Klasse AK	1.50%		Klasse NT	2.05%
	Klasse AK EUR	1.50%		Klasse S	0.15%
	Klasse AK EUR H	1.50%		Klasse S1	0.65%
	Klasse AR EUR	1.50%		Klasse S1D	0.65%
	Klasse AR EUR H	1.50%		Klasse S1D2	0.65%
	Klasse AT	1.50%		Klasse SA	0.15%
	Klasse AT AUD H	1.50%		Klasse SHK	0.15%
	Klasse AT CAD H	1.50%		Klasse W	0.95%
	Klasse AT DUR PH	1.50%		Klasse W2	0.95%
	Klasse AT EUR	1.50%		Klasse W2 CHF H	0.95%
	Klasse AT EUR H	1.50%		Klasse W2 EUR H	0.95%
	Klasse AT GBP H	1.50%		Klasse WT	0.95%
	Klasse AT HKD	1.50%		Klasse WT AUD H	0.95%
	Klasse AT NZD H	1.50%		Klasse WT EUR H	0.95%
	Klasse AT RMB H	1.50%		Klasse WT GBP H	0.95%
	Klasse AT SGD	1.50%		Klasse WT HKD	0.95%
	Klasse AT SGD H	1.50%		Klasse WT SGD H	0.95%
	Klasse B	2.20%			
	Klasse B2	2.20%			
	Klasse BT	2.20%			
	Klasse C	1.95%			
	Klasse C EUR	1.95%			
	Klasse C2	1.95%			
	Klasse C2 EUR	1.95%			
	Klasse C2 EUR H	1.95%			
	Klasse CT	1.95%			
	Klasse EA	2.00%			
	Klasse EA AUD H	2.00%			
	Klasse EA ZAR H	2.00%			
	Klasse I	0.95%			
	Klasse I EUR	0.95%			
	Klasse I2	0.95%			
	Klasse I2 AUD H	0.95%			
	Klasse I2 CHF H	0.95%			
	Klasse I2 DUR PH(g)	0.95%			
			European Income Portfolio	Klasse A	1.41%
				Klasse A USD	1.41%
				Klasse A2	1.41%
				Klasse A2 CHF H	1.41%
				Klasse A2 PLN H	1.41%
				Klasse A2 USD	1.41%
				Klasse A2 USD H	1.41%
				Klasse AA	1.41%
				Klasse AA AUD H	1.41%
				Klasse AA HKD H	1.41%
				Klasse AA RMB H	1.41%
				Klasse AA SGD H	1.41%
				Klasse AA USD H	1.41%
				Klasse AK	1.41%
				Klasse AR	1.41%
				Klasse AT	1.41%

AB FCPI-	Anteilklasse	%	AB FCPI-	Anteilklasse	%
European Income Portfolio (Fortsetzung)	Klasse AT AUD H	1.41%	Emerging Markets Debt Portfolio (Fortsetzung)	Klasse AA AUD H	1.50%
	Klasse AT SGD H	1.41%		Klasse AA CAD H	1.50%
	Klasse AT USD	1.41%		Klasse AA EUR H	1.50%
	Klasse AT USD H	1.41%		Klasse AA GBP H	1.50%
	Klasse B USD	2.11%		Klasse AA HKD	1.50%
	Klasse B2	2.11%		Klasse AA NZD H	1.50%
	Klasse B2 USD	2.11%		Klasse AA RMB H(d)	1.50%
	Klasse C	1.86%		Klasse AA SGD H(d)	1.50%
	Klasse C USD	1.86%		Klasse AA ZAR H	1.50%
	Klasse C2	1.86%		Klasse AI	1.50%
	Klasse C2 USD	1.86%		Klasse AI AUD H	1.50%
	Klasse C2 USD H	1.86%		Klasse AR EUR	1.50%
	Klasse CK	1.86%		Klasse AT	1.50%
	Klasse CT USD H	1.86%		Klasse AT AUD H	1.50%
	Klasse I	0.86%		Klasse AT CAD H	1.50%
	Klasse I USD	0.86%		Klasse AT EUR	1.50%
	Klasse I2	0.86%		Klasse AT EUR H	1.50%
	Klasse I2 AUD H	0.86%		Klasse AT GBP H	1.50%
	Klasse I2 CHF H	0.86%		Klasse AT HKD	1.50%
	Klasse I2 USD	0.86%		Klasse C EUR	1.95%
	Klasse I2 USD H	0.86%		Klasse AT NZD H	1.50%
	Klasse IA	0.86%		Klasse AT SGD H	1.50%
	Klasse IA HKD H	0.86%		Klasse BT	2.50%
	Klasse IA SGD H(d)	0.86%		Klasse C	1.95%
	Klasse IA USD H	0.86%		Klasse C2	1.95%
	Klasse IT	0.86%		Klasse C2 EUR	1.95%
	Klasse IT SGD H(d)	0.86%		Klasse C2 EUR H	1.95%
	Klasse IT USD H	0.86%		Klasse CT	1.95%
	Klasse NT USD H	1.96%		Klasse EA	2.00%
	Klasse S1	0.65%		Klasse EA AUD H	2.00%
	Klasse S1 USD	0.65%		Klasse EA ZAR H	2.00%
	Klasse S1 USD H	0.65%		Klasse EI	2.00%
	Klasse S1D	0.65%		Klasse EI AUD H	2.00%
	Klasse SA USD H	0.15%		Klasse I	0.95%
	Klasse SHK	0.15%		Klasse I2	0.95%
	Klasse W2	0.86%		Klasse I2 AUD H	0.95%
	Klasse W2 CHF H	0.86%		Klasse I2 CHF H	0.95%
	Klasse W2 USD H	0.86%		Klasse I2 EUR	0.95%
	Klasse WA	0.86%		Klasse I2 EUR H	0.95%
	Klasse WA HKD H(d)	0.86%		Klasse IT AUD H	0.95%
	Klasse WA USD H	0.86%		Klasse IT EUR H	0.95%
	Klasse WT	0.86%		Klasse N2	2.05%
	Klasse WT SGD H(d)	0.86%		Klasse NT	2.05%
	Klasse WT USD H	0.86%		Klasse S	0.15%
Emerging Markets Debt Portfolio	Klasse A	1.50%	Klasse S1 2	0.70%	
	Klasse A EUR	1.50%	Klasse S1 2 EUR(d)	0.70%	
	Klasse A2	1.50%	Klasse S1 EUR H	0.70%	
	Klasse A2 CHF H	1.50%	Klasse S1 GBP H	0.70%	
	Klasse A2 EUR	1.50%	Klasse S1L	0.70%	
	Klasse A2 EUR H	1.50%	Klasse SA	0.15%	
	Klasse A2 HKD	1.50%	Mortgage Income Portfolio	Klasse A	1.50%
	Klasse A2 PLN(d)	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 EUR H	1.50%
	Klasse AA	1.50%		Klasse A2 HKD	1.50%

AB FCPI-	Anteilklasse	%
Mortgage Income Portfolio (Fortsetzung)	Klasse A2 SGD(d)	1.50%
	Klasse A2X	1.25%
	Klasse A2X EUR	1.25%
	Klasse AA	1.50%
	Klasse AA AUD H	1.50%
	Klasse AA HKD	1.50%
	Klasse AA RMB H	1.50%
	Klasse AA SGD H	1.50%
	Klasse AA ZAR H	1.50%
	Klasse AR EUR H	1.50%
	Klasse AT	1.50%
	Klasse AT AUD H	1.50%
	Klasse AT EUR	1.50%
	Klasse AT GBP H	1.50%
	Klasse AT HKD	1.50%
	Klasse AT SGD(d)	1.50%
	Klasse AT SGD H	1.50%
	Klasse AX	1.25%
	Klasse AX EUR	1.25%
	Klasse BX	1.70%
	Klasse BX EUR	1.70%
	Klasse C	1.95%
	Klasse C2	1.95%
	Klasse C2 EUR	1.95%
	Klasse CX	1.70%
	Klasse I	0.95%
	Klasse I EUR	0.95%
	Klasse I2	0.95%
	Klasse I2 EUR	0.95%
	Klasse I2 EUR H	0.95%
	Klasse IT EUR H	0.95%
	Klasse IX	0.70%
	Klasse N2	2.05%
	Klasse NT	2.05%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.65%
	Klasse S1 AUD H	0.65%
	Klasse S1 EUR(d)	0.65%
	Klasse S1 EUR H	0.65%
	Klasse S1 JPY(i)	0.65%
	Klasse S1L	0.65%
	Klasse SA	0.15%

- (a) Letzte offizielle NIW-Berechnung am 19. September 2023.
- (b) Die Anteilklasse wurde am 8. September 2023 aufgelöst.
- (c) Die Anteilklasse wurde am 18. September 2023 aufgelöst.
- (d) Die Anteilklasse wurde am 21. November 2023 aufgelöst.
- (e) Letzte offizielle NIW-Berechnung am 8. März 2024.
- (f) Die Anteilklasse wurde am 15. Dezember 2023 aufgelöst.
- (g) Die Anteilklasse wurde am 26. Februar 2024 aufgelöst.
- (h) Die Anteilklasse wurde am 29. Mai 2024 aufgelöst.
- (i) Die Anteilklasse wurde am 8. November 2023 aufgelöst.

Folgende Tabelle gibt Aufschluss über die von der Verwaltungsgesellschaft getragenen Aufwendungen während des Geschäftsjahres zum 31. August 2024 und die Forderungen aus Aufwandserstattung zum 31. August 2024:

AB FCPI –	Getragene Aufwendungen	Forderungen aus Aufwands-erstattung
Dynamic Diversified Portfolio(a) ..	\$ 11,516	–
Global Equity Blend Portfolio	\$ 74,042	–
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	\$ 832	–
Japan Strategic Value Portfolio	¥ 27,240,273	6,856,921
China Low Volatility Equity Portfolio(b)	\$ 75,114	–
Short Duration Bond Portfolio	\$ 76,679	–
American Income Portfolio	\$ 17	–
European Income Portfolio	€ –	29
Mortgage Income Portfolio	\$ 1,398	–

- (a) Letzte offizielle NIW-Berechnung am 19. September 2023.
- (b) Letzte offizielle NIW-Berechnung am 8. März 2024.

Die von der Verwaltungsgesellschaft getragenen Aufwendungen werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen“ verbucht. Forderungen aus Aufwandserstattung werden in der Zusammensetzung des Fondsvermögens „Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten“ verbucht. Der Fonds zahlt der Verwaltungsgesellschaft außerdem eine Verwaltungsgesellschaftsgebühr.

Bestimmte Anteilklassen 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 163 bis 173) 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 AllianceBernstein 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 das Geschäftsjahr zum 31. August 2024 belief sich dieser Betrag auf \$23,178,581.

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 das Geschäftsjahr zum 31. August 2024 belief sich dieser Betrag auf \$317,785. 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* gegenüber dem Fonds erbrachte Rechtsdienste. Für das Geschäftsjahr zum 31. August 2024 wurde eine

Vergütung in Höhe von €6,272 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 das Geschäftsjahr zum 31. August 2024 wurden keine Provisionen für Wertpapiertransaktionen unter Beanspruchung der Dienste der Tochtergesellschaften, Sanford C. Bernstein & Co., LLC (bis zum 31. März 2024) und Bernstein Institutional Services LLC (seit 1. April 2024) und Bernstein Autonomous LLP. Mehrere Verwaltungsratsmitglieder des Fonds sind Mitarbeiter und/oder leitende Angestellte des Anlageverwalters und/oder seiner verbundenen Unternehmen.

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 und das AB SICAV I – US High Yield Portfolio, die von der Verwaltungsgesellschaft verwaltet werden. Das American Income Portfolio invests in 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 – USD Corporate Bond 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. Das European Income Portfolio investiert in das AB SICAV I – Euro Corporate Bond 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. In diesem Geschäftsjahr gab es keine Kauf- und Verkaufstransaktionen mit einem verbundenen Fonds.

ANMERKUNG F: Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen und Transaktionskosten

Im Geschäftsjahr zum 31. August 2024, 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 Portfolios, einschliesslich der Fälle, in denen der Anlageverwalter Anlageverwaltungsdienste an AllianceBernstein Limited delegiert, alle mit Soft Commission-Vereinbarungen verbundenen Kosten „entbündelt“ und vom Anlageverwalter oder seinen Unterauftragnehmern getragen werden, sofern 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 hilfreich 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 Geschäftsjahr zum 31. August 2024 angefallen sind, aufgeführt:

AB FCPI-	Transaktionskosten
Dynamic Diversified Portfolio(a)	\$ 2,730
Global Equity Blend Portfolio	\$ 69,751
Emerging Markets Growth Portfolio	\$ 1,203,786
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	\$ 1,062,052
Japan Strategic Value Portfolio	¥ 5,446,312
China Low Volatility Equity Portfolio(b) ..	\$ 164,924
Short Duration Bond Portfolio.....	\$ 30,201
Global High Yield Portfolio	\$ 302,744
American Income Portfolio.....	\$ 2,006,671
European Income Portfolio	€ 26,038
Emerging Markets Debt Portfolio.....	\$ 11,887
Mortgage Income Portfolio.....	\$ -0-

(a) Letzte offizielle NIW-Berechnung am 19. September 2023. Siehe Anmerkung A.

(b) Letzte offizielle NIW-Berechnung am 8. März 2024. Siehe Anmerkung A.

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 Devisenterminkontrakte werden zu Finanzberichterstattungs Zwecken unter „Unrealisierte Wertschöpfung (-minderung) aus Devisenterminkontrakten“ in der Vermögensaufstellung 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 redu-

ziert 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 31. August 2024 gab es keine Pensionsgeschäfte.

Während des Geschäftsjahres zum 31. August 2024 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 31. August 2024 bestanden keine umgekehrten Pensionsgeschäfte

Im Geschäftsjahr zum 31. August 2024 gab es keine Zinserträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften.

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, erforderliche 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 bilaterale 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 bilaterale 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 Inflations-Swap ist eine bilaterale Vereinbarung, bei der beide Parteien dem Austausch von festverzinslichen Zahlungen 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 Glatstellungstransaktion, einschließlich Händlerprovisionen, wird ebenfalls als realisierter Gewinn behandelt, bzw. als realisierter Verlust, wenn die erhaltene Prämie geringer ist als der bezahlte Betrag für die Glatstellungstransaktion.

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 Gesamttrendite eines bestimmten Vermögenswertes, eines Referenzsatzes oder eines Index. Eine Payer Swaption gibt dem Erwerber das Recht auf Zahlung der Gesamttrendite 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 31. August 2024 für bestimmte derivative Finanzinstrumente vom Broker gehalten wurden bzw. diesem zu entrichten waren:

AB FCPI –	Vom Broker gehaltene Barmittel	Dem Broker zu entrichtende Barmittel
Global Equity Blend Portfolio		
Citibank	\$ 5,424	–
JPMorgan Chase	\$ 20,048	–
Morgan Stanley	\$ 54,129	18,801
Short Duration Bond Portfolio		
Citibank	\$ 81,999	77,451
Morgan Stanley	\$ 1,289,144	589,970
Global High Yield Portfolio		
Citibank	\$ 9,499,228	9,713,004
Morgan Stanley	\$ 91,586,789	208,837,291
American Income Portfolio		
Citibank	\$ –	205,297,524
Morgan Stanley	\$ 98,969	563,265
European Income Portfolio		
Citibank	€ 1,970,730	–
Goldman Sachs	€ 200	277,382
Emerging Markets Debt Portfolio		
Citibank	\$ –	260,000
Goldman Sachs	\$ 1,238,310	–
Morgan Stanley	\$ 2,077,339	317,000
Mortgage Income Portfolio		
Morgan Stanley	\$ 2,700,862	–

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

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 31. August 2024 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
Global High Yield Portfolio		
Citibank		
U.S. Treasury Bonds, 6.75%, 08/15/2026	\$ 8,418,750	–
U.S. Treasury Notes, 4.00%, 06/30/2028	\$ 13,619,957	–
Morgan Stanley		
U.S. Treasury Bonds, 6.75%, 08/15/2026	\$ 108,975,462	–
American Income Portfolio		
Citibank		
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 08/15/2029	\$ 182,708,156	–
Morgan Stanley		
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 110,452,106	–

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 das Geschäftsjahr zum 31. August 2024 erwirtschafteten die Portefeuilles Nettogebühreneinnahmen, die in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Erträge aus der Wertpapierleihe, netto“ ausgewiesen sind.

Für das Geschäftsjahr zum 31. August 2024 verdiente Brown Brothers Harriman & Co. (in seiner Funktion als Wertpapierleihstelle) ein Honorar von \$77,999 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 31. August 2024 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	AB FCPI –	Wert	Marktwert der Sicherheiten
Global Equity Blend Portfolio.....			Japan Strategic Value Portfolio.....		
Merrill Lynch	\$ 653,733	686,563	Merrill Lynch	¥ 466,121,318	489,530,663
UBS AG	\$ 500,526	546,034	JPMorgan Chase	¥ 108,375,529	113,844,984
Emerging Markets Growth Portfolio.....			UBS AG	¥ 36,596,541	39,924,001
BNP Paribas	\$ 1,995,400	2,095,431			

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 31. August 2024 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

ANMERKUNG Q: Gemeinsame Kreditfazilität

Der Fonds beteiligt sich zusammen mit weiteren Investmentfonds (die „teilnehmenden Fonds“) an einer revolving-Kreditfazilität in Höhe von USD 300 Mio. (die „Kreditfazilität“), die vorbehaltlich bestimmter Beschränkungen eine kurzfristige Finanzierung in Verbindung mit Rücknahmen und anderen kurzfristigen Liquiditätsbedarfen bieten soll.

Die Gebühren für die Kreditfazilität werden von den teilnehmenden Fonds gezahlt und in der konsolidierten Ertrags- und Aufwandsrechnung unter „Sonstige Aufwendungen“ ausgewiesen. Der Fonds hat die Kreditfazilität im Geschäftsjahr zum 31. August 2024 nicht in Anspruch genommen.

ANMERKUNG R: Nachfolgende Ereignisse

Das Portfolio AB FCP I - Japan Strategic Value Portfolio wurde aufgelöst. Der letzte offizielle NIW wurde am 19. November 2024 berechnet.

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
<u>Dynamic Diversified Portfolio(a)</u>				
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%
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(b)	0.90%	0.10%	N/A	1.25%
IX(c)	0.70%	0.10%	N/A	1.20%
<u>Global Equity Blend Portfolio</u>				
Klasse				
A	1.60%	0.10%	N/A	2.06%
A EUR	1.60%	0.10%	N/A	2.06%
A EUR H	1.60%	0.10%	N/A	2.05%
A SGD	1.60%	0.10%	N/A	2.06%
B	1.60%	0.10%	1.00%	3.06%
B SGD	1.60%	0.10%	1.00%	3.08%
C	2.05%	0.10%	N/A	2.51%
C EUR	2.05%	0.10%	N/A	2.32%
I	0.80%	0.10%	N/A	1.24%
I EUR	0.80%	0.10%	N/A	1.26%
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%
<u>Emerging Markets Growth Portfolio</u>				
Klasse				
A	1.70%	0.10%	N/A	2.01%
A AUD H	1.70%	0.10%	N/A	2.01%
A EUR	1.70%	0.10%	N/A	2.01%
A HKD	1.70%	0.10%	N/A	2.01%
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	2.00%
AD	1.70%	0.10%	N/A	2.01%
B	1.70%	0.10%	1.00%	3.01%
C	2.15%	0.10%	N/A	2.46%
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	1.21%
I AUD H	0.90%	0.10%	N/A	1.21%
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	1.05%
S1 GBP	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.00%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Asia Ex-Japan Equity Portfolio				
Klasse				
A	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
A AUD H	1.70%	0.05%	N/A	2.03%
A EUR	1.70%	0.05%	N/A	2.03%
A HKD	1.70%	0.05%	N/A	2.04%
A SGD H	1.70%	0.05%	N/A	2.03%
AD	1.70%	0.05%	N/A	2.03%
AD AUD H	1.70%	0.05%	N/A	2.03%
AD CAD H	1.70%	0.05%	N/A	2.03%
AD EUR	1.70%	0.05%	N/A	2.03%
AD EUR H	1.70%	0.05%	N/A	2.03%
AD GBP H	1.70%	0.05%	N/A	2.04%
AD HKD	1.70%	0.05%	N/A	2.03%
AD NZD H	1.70%	0.05%	N/A	2.03%
AD RMB H(d)	1.70%	0.05%	N/A	2.02%
AD ZAR H	1.70%	0.05%	N/A	2.03%
AY JPY	1.70%	0.05%	N/A	2.03%
BY JPY	1.45%	0.05%	0.72%	2.52%
C	2.15%	0.05%	N/A	2.49%
C EUR	2.15%	0.05%	N/A	2.45%
ED	1.70%	0.05%	1.00%	3.05%
ED AUD H	1.70%	0.05%	1.00%	3.00%
I	0.90%	0.05%	N/A	1.20%
I AUD H(d)	0.90%	0.05%	N/A	1.23%
I EUR	0.90%	0.05%	N/A	1.25%
I GBP	0.90%	0.05%	N/A	1.17%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.18%
S HKD	N/A	0.01%(8)	N/A	0.18%
S1	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.08%
S1 EUR	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.05%
SD	N/A	0.01%(8)	N/A	0.18%
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(d)	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	2.58%
C EUR	1.95%	0.05%	N/A	2.55%
C EUR H	1.95%	0.05%	N/A	2.58%
C USD	1.95%	0.05%	N/A	2.58%
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%

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Japan Strategic Value Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
I USD.....	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
I USD H.....	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
S EUR H(d).....	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(e)

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%
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%
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(f).....	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	1.16%
A EUR.....	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
A2.....	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
A2 EUR.....	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
A2 EUR H.....	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
A2 HKD.....	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
A2 SGD H.....	0.85%	0.10%	N/A	0.59%
AA.....	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AA AUD H.....	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AA CAD H.....	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AA GBP H.....	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AA HKD.....	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AA SGD H.....	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AJ.....	0.65%	0.10%	N/A	0.97%
AT.....	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AT AUD H.....	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AT CAD H.....	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AT EUR.....	0.85%	0.10%	N/A	1.14%
AT EUR H.....	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AT GBP H.....	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AT HKD.....	0.85%	0.10%	N/A	1.13%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Short Duration Bond Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
AT NZD H	0.85%	0.10%	N/A	1.15%
AT SGD H	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AX	0.65%	0.10%	N/A	0.96%
C	1.25%	0.10%	N/A	1.57%
C2	1.25%	0.10%	N/A	1.56%
C2 EUR H(d)	1.25%	0.10%	N/A	1.55%
I	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
I EUR(d)	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
I2	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
I2 EUR(d)	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
I2 EUR H	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
IT	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
N2	1.35%	0.10%	N/A	1.66%
NT	1.35%	0.10%	N/A	1.66%
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	0.34%
S1 EUR H	0.25%	0.01%(8)	N/A	0.35%
S1T	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	1.64%
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	1.64%
AR EUR H	1.41%(1)	0.10%	N/A	1.64%
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%

Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)**

Klasse	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
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%
BT	1.41%(1)	0.10%	1.00%	2.64%
BT AUD H	1.41%(1)	0.10%	1.00%	2.64%
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	2.14%
C2 EUR	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.14%
C2 EUR H	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.14%
CK(d)	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.08%
CK EUR H(d)	1.91%(2)	0.10%	N/A	2.09%
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	1.14%
I2 EUR	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.15%
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%
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	1.10%
IT HKD	0.91%(3)	0.10%	N/A	1.15%
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	0.93%
S1 EUR(d)	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.91%
S1 EUR H	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.93%
S1D	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.93%
S1D2	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.93%
S1L GBP H	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.97%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.03%
SHK	N/A	0.01%(8)	N/A	0.03%
SK	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.68%
W	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
W EUR	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
W2	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
W2 CHF H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
W2 EUR H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Global High Yield Portfolio** (Fortsetzung)				
Klasse				
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	0.97%
WT GBP H.....	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
WT RMB H.....	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.95%
American Income Portfolio**				
Klasse				
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	1.31%
A2 DUR PH.....	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
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	1.32%
AR EUR H.....	1.10%	0.10%	N/A	1.33%
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%
BT.....	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
C.....	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
C EUR.....	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
C2.....	1.55%	0.10%	N/A	1.77%

American Income Portfolio (Fortsetzung)**

Klasse	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
C2 EUR	1.55%	0.10%	N/A	1.77%
C2 EUR H	1.55%	0.10%	N/A	1.75%
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%
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	0.77%
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	0.76%
I2 DUR PH(g)	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	0.74%
I2 SGD(d)	0.55%	0.10%	N/A	0.73%
I2 SGD H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
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	0.77%
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	0.77%
IT GBP H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT HKD	0.55%	0.10%	N/A	0.78%
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	0.77%
IT RMB H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT SGD(h)	0.55%	0.10%	N/A	0.78%
IT SGD H	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
J	1.10%	0.10%	0.70%	2.02%
L2(d)	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
LT(d)	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%
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	0.60%
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	0.60%
WT	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
WT AUD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.61%
WT EUR H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
WT GBP H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
WT HKD	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.60%
WT SGD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.61%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
European Income Portfolio				
Klasse				
A	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
A USD	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
A2	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
A2 CHF H	1.10%	0.10%	N/A	1.35%
A2 PLN H	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
A2 USD	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
A2 USD H	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AA	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AA AUD H	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AA HKD H	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AA RMB H	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AA SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AA USD H	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AK	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AR	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AT	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AT AUD H	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AT SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AT USD	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AT USD H	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
B USD	1.10%	0.10%	0.70%	2.06%
B2	1.10%	0.10%	0.70%	2.04%
B2 USD	1.10%	0.10%	0.70%	2.04%
C	1.55%	0.10%	N/A	1.81%
C USD	1.55%	0.10%	N/A	1.81%
C2	1.55%	0.10%	N/A	1.80%
C2 USD	1.55%	0.10%	N/A	1.81%
C2 USD H	1.55%	0.10%	N/A	1.80%
CK	1.55%	0.10%	N/A	1.81%
CT USD H	1.55%	0.10%	N/A	1.81%
I	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
I USD	0.55%	0.10%	N/A	0.80%
I2	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
I2 AUD H	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
I2 CHF H	0.55%	0.10%	N/A	0.79%
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	0.81%
IA HKD H	0.55%	0.10%	N/A	0.80%
IA SGD H(d)	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
IA USD H	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
IT	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
IT SGD H(d)	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
IT USD H	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
NT USD H	1.65%	0.10%	N/A	1.91%
S1	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.58%
S1 USD	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.55%
S1 USD H	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.59%
S1D	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.59%
SA USD H	N/A	0.01%(8)	N/A	0.09%
SHK	N/A	0.01%(8)	N/A	0.09%
W2	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.61%
W2 CHF H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.63%
W2 USD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.64%

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
European Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
WA	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.64%
WA HKD H(d)	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.58%
WA USD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.64%
WT	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.64%
WT SGD H(d)	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.59%
WT USD H	0.385%(10)	0.10%	N/A	0.64%
Emerging Markets Debt Portfolio**				
Klasse				
A	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
A EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
A2 CHF H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
A2 EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
A2 EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
A2 HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
A2 PLN(d)	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
A2 PLN H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
A2 SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
AA	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
AA AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
AA CAD H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
AA EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AA GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
AA HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.38%
AA NZD H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
AA RMB H(d)	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AA SGD H(d)	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AA ZAR H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
AI	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AI AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
AR EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
AT AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
AT CAD H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
AT EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
AT EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
AT GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
AT HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
AT NZD H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
AT SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
BT	1.10%	0.05%	1.00%	2.37%
C	1.55%	0.05%	N/A	1.82%
C EUR	1.55%	0.05%	N/A	1.79%
C2	1.55%	0.05%	N/A	1.82%
C2 EUR	1.55%	0.05%	N/A	1.80%
C2 EUR H	1.55%	0.05%	N/A	1.80%
CT	1.55%	0.05%	N/A	1.80%
EA	1.10%	0.05%	0.50%	1.88%
EA AUD H	1.10%	0.05%	0.50%	1.87%
EA ZAR H	1.10%	0.05%	0.50%	1.87%
EI	1.10%	0.05%	0.50%	1.87%
EI AUD H	1.10%	0.05%	0.50%	1.87%
I	0.55%	0.05%	N/A	0.82%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
Emerging Markets Debt Portfolio** (Fortsetzung)				
Klasse				
I2	0.55%	0.05%	N/A	0.83%
I2 AUD H	0.55%	0.05%	N/A	0.82%
I2 CHF H	0.55%	0.05%	N/A	0.79%
I2 EUR	0.55%	0.05%	N/A	0.82%
I2 EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.82%
IT AUD H	0.55%	0.05%	N/A	0.80%
IT EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.82%
N2	1.65%	0.05%	N/A	1.92%
NT	1.65%	0.05%	N/A	1.92%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S1 2	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.67%
S1 2 EUR(d)	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.62%
S1 EUR H	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.62%
S1 GBP H	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.63%
S1L	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.67%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.12%
Mortgage Income Portfolio				
Klasse				
A	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
A2 EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
A2 EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
A2 HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
A2 SGD(d)	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
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	1.32%
AA AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AA HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AA RMB H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AA SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.30%
AA ZAR H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AR EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AT	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AT AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AT EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AT GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AT HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AT SGD(d)	1.10%	0.05%	N/A	1.29%
AT SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
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	1.77%
C2	1.55%	0.05%	N/A	1.77%
C2 EUR	1.55%	0.05%	N/A	1.73%
CX	1.50%(6)	0.05%	N/A	1.70%
I	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
I EUR	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
I2	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
I2 EUR	0.55%	0.05%	N/A	0.76%
I2 EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.77%

Mortgage Income Portfolio (Fortsetzung)

Klasse	Verwaltungs- gebühr	Verwaltungsgesellschafts- gebühr	Ausschüttungs- gebühr	Gesamt- kostenquote*
IT EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.76%
IX	0.50%(7)	0.05%	N/A	0.70%
N2	1.65%	0.05%	N/A	1.87%
NT	1.65%	0.05%	N/A	1.87%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.06%
S1	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.59%
S1 AUD H	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.59%
S1 EUR(d)	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.55%
S1 EUR H	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.55%
S1 JPY(i)	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.59%
S1L	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.56%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.09%

* Ungeprüft. Annualisierte Sätze. Bei der Berechnung der Gesamtkostenquote werden die von der SFAMA 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.

- (a) Letzte offizielle NIW-Berechnung am 19. September 2023. Siehe Anmerkung A.
- (b) Die Anteilklasse wurde am 8. September 2023 aufgelöst.
- (c) Die Anteilklasse wurde am 18. September 2023 aufgelöst.
- (d) Die Anteilklasse wurde am 21. November 2023 aufgelöst.
- (e) Letzte offizielle NIW-Berechnung am 8. März 2024. Siehe Anmerkung A.
- (f) Die Anteilklasse wurde am 15. Dezember 2023 aufgelöst.
- (g) Die Anteilklasse wurde am 26. Februar 2024 aufgelöst.
- (h) Die Anteilklasse wurde am 29. Mai 2024 aufgelöst.
- (i) Die Anteilklasse wurde am 8. November 2023 aufgelöst.

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

- (1) Max 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.
- (2) Max 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.
- (3) Max 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.
- (4) Max 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.
- (5) 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.
- (6) 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.
- (7) 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

- (8) 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

- (9) Max 1.15%
- (10) Max 0.55%

TABELLE 2
PORTEFEUILLEUMSATZ

AB FCPI

	<u>Umsatz*</u>
AB FCPI-	
Global Equity Blend Portfolio	117.56%
Emerging Markets Growth Portfolio	80.11%
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	66.98%
Japan Strategic Value Portfolio	10.16%
Short Duration Bond Portfolio	192.20%
Global High Yield Portfolio	(6.13)%
American Income Portfolio	16.71%
European Income Portfolio	46.60%
Emerging Markets Debt Portfolio	146.40%
Mortgage Income Portfolio	(45.69)%

* Ungeprüft.

An die Anteilhaber von AB FCP I

Bestätigungsvermerk

Wir haben den Jahresabschluss von AB FCP I (der „Fonds“) und der einzelnen Portefeuilles geprüft, der aus der Zusammensetzung des Fondsvermögens und dem Verzeichnis der Anlagewerte zum 31. August 2024, der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens für das zu diesem Zeitpunkt abgelaufene Geschäftsjahr und den Anmerkungen zum Jahresabschluss, darunter eine Zusammenfassung der relevanten Bilanzierungsgrundsätze, besteht.

Wir sind der Ansicht, dass der Jahresabschluss in Übereinstimmung mit den gesetzlichen und aufsichtsbehördlichen Vorschriften Luxemburgs für die Erstellung und Präsentation von Jahresabschlüssen eine wahrheitsgetreue und angemessene Darstellung der finanziellen Lage des Fonds und jedes seiner Portefeuilles zum 31. August 2024 sowie der Ergebnisse seiner Investitionstätigkeit und der Entwicklung seines Nettovermögens für das zu diesem Zeitpunkt ablaufende Geschäftsjahr liefert.

Grundlage für den Bestätigungsvermerk

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016, über die Prüfungstätigkeit (das „Gesetz vom 23. Juli 2016“) und den in Luxemburg von der „Commission de Surveillance du Secteur Financier“ (CSSF) umgesetzten Internationalen Abschlussprüfungsgrundsätzen (ISA) durchgeführt. Unsere Pflichten im Rahmen des Gesetzes vom 23. Juli 2016, und der ISA, die von der CSSF für Luxemburg übernommen wurden, sind im Abschnitt „Pflichten des „réviseur d'entreprises agréé“ in Bezug auf die Prüfung des Abschlusses“ in unserem Bericht näher beschrieben. Wir sind zudem gemäß dem vom International Ethics Standards Board for Accountants herausgegebenen International Code of Ethics for Professional Accountants, einschließlich der International Independence Standards („IESBA-Kodex“), in der von der CSSF für Luxemburg angenommenen Form sowie den für unsere Prüfung des Abschlusses relevanten ethischen Anforderungen von dem Fonds unabhängig und haben unsere sonstigen ethischen Verpflichtungen gemäß diesen ethischen Anforderungen erfüllt. Nach unserer Auffassung sind die erhaltenen Prüfungsnachweise als Grundlage für die Erteilung unseres Bestätigungsvermerks ausreichend und angemessen.

Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft (der „Verwaltungsrat“) ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Informationen, jedoch nicht den Abschluss und unseren dazugehörigen Bericht des „réviseur d'entreprises agréé“.

Unser Bestätigungsvermerk zum Abschluss bezieht sich nicht auf die sonstigen Informationen und wir geben keinerlei Art von Prüfungsurteil hinsichtlich der Zuverlässigkeit der sonstigen Informationen ab.

In Verbindung mit unserer Prüfung des Abschlusses sind wir dafür verantwortlich, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob die sonstigen Informationen wesentlich im Widerspruch zum Abschluss oder zu unserem bei der Abschlussprüfung erlangten Wissen stehen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Wenn wir aufgrund der von uns durchgeführten Arbeit zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informa-

tionen vorliegt, müssen wir über diese Tatsache berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats für den Abschluss

Der Verwaltungsrat ist für die Aufstellung und sachgerechte Darstellung dieses Abschlusses in Übereinstimmung mit den gesetzlichen und aufsichtsbehördlichen Vorschriften Luxemburgs in Bezug auf die Erstellung und Darstellung des Abschlusses verantwortlich, sowie für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat für erforderlich hält, um die Erstellung von Abschlüssen zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind.

Bei der Erstellung des Jahresabschlusses ist der Verwaltungsrat dafür verantwortlich, die Fähigkeit des Fonds und jedes seiner Portefeuilles zur Unternehmensfortführung zu bewerten, wobei er gegebenenfalls Fragen im Zusammenhang mit der Unternehmensfortführung offenlegt und die Rechnungslegung auf dem Grundsatz der Unternehmensfortführung vornimmt, es sei denn, der Verwaltungsrat beabsichtigt, den Fonds oder eines seiner Portefeuilles zu liquidieren oder seine Geschäftstätigkeit einzustellen, oder er hat keine realistische Alternative, als so zu handeln.

Pflichten des „réviseur d'entreprises agréé“ in Bezug auf die Prüfung des Abschlusses

Das Ziel unserer Prüfung ist es, eine angemessene Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss insgesamt frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, und einen Bericht des „réviseur d'entreprises agréé“ zu erstellen, der unseren Bestätigungsvermerk enthält. Die angemessene Sicherheit stellt einen hohen Grad an Sicherheit dar, ist jedoch keine Garantie dafür, dass bestehende wesentliche falsche Darstellungen bei einer gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den in Luxemburg von der CSSF umgesetzten ISA durchgeführten Abschlussprüfung immer entdeckt werden. Falsche Darstellungen können durch dolose Handlungen oder Irrtümer entstehen und gelten als wesentlich, wenn vernünftigerweise erwartet werden kann, dass sie einzeln oder insgesamt die wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen, die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffen werden.

Im Rahmen unserer Abschlussprüfung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den in Luxemburg von der CSSF umgesetzten ISA gehen wir während der gesamten Abschlussprüfung nach pflichtgemäßem Ermessen und mit professioneller Skepsis vor. Des Weiteren umfasst unsere Prüfung:

- Die Identifizierung und Beurteilung des Risikos wesentlicher falscher Darstellungen im Abschluss aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, die Planung und Durchführung von Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken und die Erlangung von Prüfungsnachweisen, die als Grundlage für die Erteilung unseres Bestätigungsvermerks ausreichend und angemessen sind. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen nicht entdeckt werden, ist höher als bei wesentlichen falschen Darstellungen, die aus Irrtümern resultieren, da dolose Handlungen geheime Absprachen, Fälschungen, gezielte Auslassungen, falsche Angaben wesentlicher Umstände oder die Umgehung interner Kontrollen beinhalten können.

- Erlangung eines Verständnisses der für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollen, um den Umständen angemessene Prüfungsverfahren zu erarbeiten, jedoch nicht, um eine Meinung über die Wirksamkeit der internen Kontrollen des Fonds abzugeben.
- Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden und der Angemessenheit der vom Verwaltungsrat vorgenommenen Schätzungen in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.
- Abschließende Feststellung, ob die Anwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung bei der Rechnungslegung durch den Verwaltungsrat angemessen ist und ob auf Basis der erlangten Prüfungsnachweise eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Bedingungen besteht, die erhebliche Zweifel an der Fähigkeit des Fonds oder eines seiner Portefeuilles zur Unternehmensfortführung aufwerfen könnten. Wenn wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Bericht des „réviseur d’entreprises agréé“ auf die entsprechenden Offenlegungen im Abschluss hinzuweisen bzw. unseren Bestätigungsvermerk zu ändern, falls die Offenlegungen unangemessen sind. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den bis zum Datum des Berichts des „réviseur d’entreprises agréé“ erlangten Prüfungsnachweisen. Allerdings können zukünftige Ereignisse oder Bedingungen dazu führen, dass der Fonds oder eines seiner Portefeuilles nicht mehr fortgeführt werden kann.
- In Bezug auf das Portefeuille, dessen Schließung beschlossen wurde oder beabsichtigt ist, stellen wir abschließend fest, ob die Abkehr von der Fortführungsannahme bei der Rechnungslegung angemessen ist. Wir bewerten auch die

Angemessenheit der Angaben, die die Nichtanwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung bei der Rechnungslegung und die Gründe für seine Anwendung beschreiben. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den bis zum Datum unseres Berichts des „réviseur d’entreprises agréé“ erlangten Prüfungsnachweisen.

- Beurteilung der Gesamtdarstellung und Struktur des Abschlusses sowie seines Inhalts, einschließlich der Offenlegungen, und der Frage, ob die zugrunde liegenden Transaktionen und Ereignisse im Abschluss so dargestellt sind, dass ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild erreicht wird.

Wir kommunizieren mit den für die Überwachung Verantwortlichen, unter anderem in Bezug auf den geplanten Umfang und den Zeitplan für die Abschlussprüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich eventueller bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung entdecken.

Außerdem geben wir den mit der Unternehmensführung beauftragten Personen eine Erklärung ab, dass wir die einschlägigen ethischen Anforderungen an die Unabhängigkeit erfüllt haben, und teilen ihnen alle Beziehungen und sonstigen Sachverhalte mit, von denen vernünftigerweise angenommen werden kann, dass sie sich auf unsere Unabhängigkeit auswirken, sowie gegebenenfalls die demgegenüber getroffenen Schutzvorkehrungen.

Ernst & Young
Société Anonyme
Cabinet de révision agréé

Kerry-ann Au Yeong
Luxemburg, 20. Dezember 2024

Wie im Prospekt dargelegt, kann der Anlageverwalter bei der Umsetzung der jeweiligen Anlagestrategie der Portfeuille 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 das Geschäftsjahr zum 31. August 2024 hat der Anlageverwalter die Anlageverwaltungsdienstleistungen für die nachstehend aufgeführten Portfeuille an die folgenden verbundenen Unteranlageverwalter übertragen:

AllianceBernstein Australia Limited:

- Asia Ex-Japan Equity Portfolio

AllianceBernstein Limited:

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

AllianceBernstein Hong Kong Limited:

- Emerging Markets Debt Portfolio
- Asia Ex-Japan Equity Portfolio

AllianceBernstein (Singapore) Ltd.:

- Emerging Markets Growth Portfolio

AllianceBernstein (Japan) Ltd.:

- Japan Strategic Value Portfolio

Finanzinformationen zum Fonds

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

Bitte beachten Sie, dass bei den Portfeuille, 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 Klasse S1B GB sind nur für britische/irische institutionelle Anleger verfügbar, die zur Zufriedenheit der Verwaltungsgesellschaft nachweisen, dass sie gemäß dem jeweiligen Steuerabkommen zwischen dem Land des steuerlichen Wohnsitzes des Anlegers und den Vereinigten Staaten Anspruch auf eine ermäßigte Quellensteuer von 15% auf Dividendenerträge aus den USA haben, und die sich bereit erklären, der Verwal-

tungsgesellschaft bestimmte andere Bestätigungen und Informationen vorzulegen, soweit dies zur Feststellung ihrer Berechtigung zum Erwerb dieser Anteile erforderlich ist.

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

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

Allfunds Bank, S.A. Milan Branch
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 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

Proservice Finteco Spółka z o.o. (bis 31. Dezember 2023)
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 Zahlstelle. Der Prospekt, die Basisinformationsblätter, 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.

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, Polen, 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 der AllianceBernstein (Luxemburg) S.à r.l. bearbeitet.

Die Basisinformationsblätter (KIDs) des Fonds werden unter www.alliancebernstein.com/go/kid zur Verfügung gestellt.

Mitteilungen an die Anteilinhaber

Soweit laut Gesetzgebung und anwendbarer Bestimmungen vorgeschrieben, werden Mitteilungen an die Anteilinhaber im *Recueil Electronique des Sociétés et Associations* 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 Berichtszeitraums erfolgte Änderungen des Anlageportefeuilles werden den Anteilinhabern am Hauptsitz der Verwaltungsgesellschaft kostenlos zur Verfügung gestellt.

Richtlinie zu umstrittenen Waffen

Die Verwaltungsgesellschaft veranlasst die weltweite Überprüfung von Unternehmen auf ihre Beteiligung an der Herstellung von Antipersonenminen, Streumunition und/oder Munition, die mit abgereichertem Uran, biologischen Waffen, chemischen Waffen und/oder Brandwaffen hergestellt wird. In den Fällen, in denen eine solche Beteiligung an der Herstellung verifiziert wurde, ist es die Politik der Verwaltungsgesellschaft, dem Fonds nicht zu gestatten, in Wertpapiere zu investieren, die von solchen Unternehmen ausgegeben werden.

Value-at-Risk (gefährdeter Wert)

Für OGAWs kann der Value-at-Risk (VaR) auf absoluter oder relativer Basis gemessen werden. Der VaR ist ein verbreitet verwendeter Risikomaßstab für das Verlustrisiko eines bestimmten Portefeuilles an Finanzanlagen.

Für die Rentenportefeuilles hat der Anlageverwalter das Gesamtrisiko (Marktrisiko) unter Verwendung des auf absoluter

Basis errechneten VaR überwacht (nach dem der VaR des betreffenden Portefeuilles 20% seines NAV nicht übersteigen darf).

Während des besagten Geschäftsjahres lauteten die Tiefst-, Höchst- und Durchschnittswerte für den VaR der einzelnen Portefeuilles auf absoluter Basis gemessen folgendermaßen:

Portefeuille	Tiefstwert	Höchstwert	Durchschnitt
Short Duration Bond Portfolio.....	0.59%	2.22%	1.05%
Global High Yield Portfolio.....	2.16%	3.01%	2.61%
American Income Portfolio.....	3.30%	4.50%	3.86%
European Income Portfolio.....	2.71%	4.46%	3.44%
Emerging Markets Debt Portfolio.....	4.21%	5.46%	4.70%
Mortgage Income Portfolio.....	0.54%	2.45%	0.86%

Der VaR der einzelnen Portefeuilles und der VaR der Vergleichsgrößen wurden auf Grundlage eines „historischen“ Modells mit

einem Vertrauensniveau von 99% und einem Beobachtungszeitraum von einem Monat oder 20 Tagen errechnet.

Fremdfinanzierung

Für nachstehende Portefeuilles erwartet der Anlageverwalter, dass er keine Bankdarlehen benutzen wird, um die Anlagestrategie des Portefeuilles umzusetzen.

Das erwartete Fremdfinanzierungsniveau wird als Summe der Nominalbeträge der derivativen Finanzinstrumente berechnet, die vom Portefeuille gehalten werden. Laut CSSF-Rundschreiben 11/512 vom 30. Mai 2011 berücksichtigt diese Berechnungsmethode weder die Tatsache, dass ein bestimmtes derivatives Finanzinstrument das Anlagerisiko des Portefeuilles erhöht oder senkt, noch erlaubt sie es, derivative Finanzinstrumente mit umgekehrten Positionen zu verrechnen. Anleger sollten sich dessen bewusst sein, dass (i) ein höheres erwartetes Fremdfinanzierungsniveau nicht automatisch ein höheres Anlagerisiko impliziert und (ii) dass das oben angegebene erwartete Fremdfinanzierungsniveau überwiegend die Verwendung von Derivaten zu Absicherungszwecken oder zum effizienten Portefeuillemanagement widerspiegelt. Darüber hinaus kann das tatsächliche Fremdfinanzierungsniveau des Portefeuilles

von dem nachstehend genannten erwarteten Fremdfinanzierungsniveau abweichen:

- Short Duration Bond Portfolio
0%-150% des NAV des Portefeuilles
- Global High Yield Portfolio
0%-100% des NAV des Portefeuilles
- American Income Portfolio
0%-100% des NAV des Portefeuilles
- European Income Portfolio
0%-100% des NAV des Portefeuilles
- Emerging Markets Debt Portfolio
0%-100% des NAV des Portefeuilles
- Mortgage Income Portfolio
0%-100% des NAV des Portefeuilles

Infolge der Verwendung des Summe-der-Nominalbeträge-Ansatzes beträgt die durchschnittliche Fremdfinanzierung der Portefeuilles für das Geschäftsjahr zum 31. August 2024:

Portfeuille	Fremdfinanzierung
Short Duration Bond Portfolio.....	96.58%
Global High Yield Portfolio.....	31.13%
American Income Portfolio	67.56%
European Income Portfolio.....	43.76%
Emerging Markets Debt Portfolio.....	39.91%
Mortgage Income Portfolio.....	15.30%

Für die unten aufgeführten Portfeuille hat der Anlageverwalter den Commitment-Ansatz gemäß CSSF-Rundschreiben 11/512 vom 30. Mai 2011 angewendet, um das Gesamtrisiko (Marktrisiko) zu überwachen, das sich aus der Verwendung von derivativen Finanzinstrumenten ergibt. Folglich wird

das Netto-Derivatrisiko, das aus Derivattransaktionen sowie Barmitteln und anderen Anlagen entsteht, dem NAV des Portfeuille weitgehend entsprechen.

Infolge der Verwendung des Commitment-Ansatzes betrug die durchschnittliche Fremdfinanzierung der Portfeuille im Geschäftsjahr zum 31. August 2024:

Portfeuille	Fremdfinanzierung
Global Equity Blend Portfolio	5.06%
Emerging Markets Growth Portfolio	1.77%
Asia Ex-Japan Equity Portfolio.....	0.23%
Japan Strategic Value Portfolio.....	0.02%

Vergütung

Vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 (der „Referenzzeitraum“) belief sich der Gesamtbetrag der von der Verwaltungsgesellschaft in bar und/oder in Form von Wertpapieren mit Verfügungsbeschränkung an ihre gesamte Belegschaft (die sich während des Referenzzeitraums im Durchschnitt aus 100 Mitarbeitern zusammensetzte) gezahlten Vergütung auf EUR 21,251,629.

Insbesondere war der oben genannte Gesamtbetrag der im Referenzzeitraum gezahlten Vergütung folgendermaßen in eine feste und eine variable Vergütung unterteilt

- Feste Vergütung: EUR 12,144,465
- Variable Vergütung: EUR 9,107,164

Im Referenzzeitraum belief sich der Gesamtbetrag der Vergütung, die an die identifizierte Belegschaft gezahlt wurde, die während des Referenzzeitraums aus 7 Mitarbeitern bestand, auf EUR 1,635,957 (wie folgt aufgeteilt: feste Vergütung EUR 1,229,357 und variable Vergütung EUR 406,600) - was weniger als 8% der Gesamtvergütung entspricht.

Die oben genannten identifizierten Mitarbeiter setzen sich aus folgenden Kategorien von Mitarbeitern zusammen:

- a) Geschäftsleitung (während des Berichtszeitraums fünf), b) Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft, deren Handlungen einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil der Verwaltungsgesellschaft haben können oder unter die Vergütungsstufe der Geschäftsleitung fallen und die Risiken eingehen (während des Berichtszeitraums keine), und c) Kontrollfunktionen (während des Berichtszeitraums zwei).

Detaillierte Informationen zu den finanziellen und nicht finanziellen Kriterien der Vergütungspolitik und -praxis, zum Entscheidungsfindungsprozess bei der Festlegung der Vergütungspolitik sowie zum Zusammenhang zwischen Bezahlung und Leistung sind im Vergütungsbericht auf der Website von AB Global verfügbar:

www.alliancebernstein.com/go/remuneration_policy

Während des Referenzzeitraums wurde eine Überprüfung der Vergütungspolitik und ihrer Umsetzung vorgenommen, wobei keine Unregelmäßigkeiten aufgedeckt wurden. Schließlich wurde während des Referenzzeitraums keine wesentliche Änderung an der Vergütungspolitik in ihrer ursprünglich vorgesehenen Form vorgenommen.

Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

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 Kaufs-/Rückverkaufsgeschäft oder Verkaufs-/Rückkaufgeschäft; oder
- ein Margenleihgeschäft.

Zum 31. August 2024 war der Fonds in Wertpapierleihgeschäften engagiert die als Transaktionstyp unter die SFT-Verordnung fallen.

Allgemeine Angaben

Zum 31. August 2024 belief sich das Vermögen über alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte hinweg auf folgende Beträge:

Global Equity Blend Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$1,154,259	1.15%	4.66%

Emerging Markets Growth Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$1,995,400	0.37%	0.74%

Japan Strategic Value Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	¥611,093,388	7.38%	14.71%

Angaben zur Wiederverwendung von Sicherheiten

Im Geschäftsjahr zum 31. August 2024 wurden keine Sicherheiten wiederverwendet.

Im Geschäftsjahr zum 31. August 2024 wurden keine Barsicherheiten wiederangelegt.

Angaben zur Konzentration

Zum 31. August 2024 waren Folgende die zehn größten Emittenten der bezüglich sämtlicher Wertpapierfinanzierungsgeschäfte erhaltenen Wertpapiersicherheiten:

Wertpapierleihe

Global Equity Blend Portfolio

Nr.	Sicherheitsemitenten	Betrag
1	Französische Regierung	\$337,824
2	Britische Regierung	\$318,063
3	US-Regierung	\$296,731
4	Deutsche Regierung	\$220,830
5	Niederländische Regierung	\$56,358
6	Schweizer Regierung	\$2,791

Emerging Markets Growth Portfolio

Nr.	Sicherheitsemitenten	Betrag
1	Britische Regierung	\$747,893
2	Französische Regierung	\$617,326
3	Deutsche Regierung	\$460,784
4	Niederländische Regierung	\$269,428

Japan Strategic Value Portfolio

Nr.	Sicherheitsemitenten	Betrag
1	Britische Regierung	¥226,784,072
2	US-Regierung	¥194,128,835
3	Französische Regierung	¥123,807,346
4	Deutsche Regierung	¥94,254,623
5	Niederländische Regierung	¥4,120,704
6	Schweizer Regierung	¥204,068

Zum 31. August 2024 waren Folgende die zehn größten Gegenparteien bezüglich sämtlicher Wertpapierfinanzierungsgeschäfte:

Global Equity Blend Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Merrill Lynch	\$653,733
	2	UBS AG	\$500,526

Emerging Markets Growth Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	BNP Paribas	\$1,995,400

Japan Strategic Value Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Merrill Lynch	¥466,121,318
	2	JPMorgan Chase	¥108,375,529
	3	UBS AG	¥36,596,541

Verwahrung der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapierleihe

Zum 31. August 2024 hielten vier Depotbanken die folgenden erhaltenen Sicherheiten:

Global Equity Blend Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Clearstream	Wertpapiersicherheit	\$372,882
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$368,502
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	\$296,731
CREST	Wertpapiersicherheit	\$194,482

Emerging Markets Growth Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$1,347,538
CREST	Wertpapiersicherheit	\$747,893

Japan Strategic Value Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	¥283,238,402
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	¥194,128,835
CREST	Wertpapiersicherheit	¥138,668,632
Clearstream	Wertpapiersicherheit	¥27,263,779

Erträge/Kosten

Im Geschäftsjahr zum 31. August 2024 belaufen sich die Erträge und Kosten für alle Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften auf Folgendes:

Wertpapierleihe

Global Equity Blend Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$8,646	80%
Für dritte Partei	\$2,162	20%

Emerging Markets Growth Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$52,775	80%
Für dritte Partei	\$13,194	20%

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$105	80%
Für dritte Partei	\$26	20%

Japan Strategic Value Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	¥4,105,687	80%
Für dritte Partei	¥1,026,422	20%

China Low Volatility Equity Portfolio

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

Zusammenfassende Transaktionsangaben

Zum 31. August 2024 besitzen die verschiedenen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte 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	\$1,154,259

Emerging Markets Growth 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	\$1,995,400

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	¥611,093,388

Zum 31. August 2024 kommen folgende Abrechnungs- und Clearing-Mechanismen für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte zum Einsatz:

Wertpapierleihe

Global Equity Blend Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$1,154,259

Emerging Markets Growth Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$1,995,400

Japan Strategic Value Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	¥611,093,388

Die zusammenfassenden Transaktionsangaben für Sicherheitspositionen (einschließlich Barmittel), die zum 31. August 2024 für sämtliche Wertpapierfinanzierungsgeschäfte erhalten wurden, lauten folgendermaßen:

Wertpapierleihe
Global Equity Blend Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 2.50%, 09/24/2027	\$123,581	AA-	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 01/31/2028	\$123,581	AA	>1 Jahr	£	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.38%, 10/15/2028	\$123,579	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 08/10/2028	\$111,446	AA	>1 Jahr	£	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 3.10%, 09/18/2025	\$90,042	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 3.25%, 01/31/2033	\$83,036	AA	>1 Jahr	£	USA
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.63%, 08/15/2030	\$64,618	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 5.50%, 04/25/2029	\$64,618	AA-	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 1.25%, 11/30/2026	\$64,616	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.75%, 05/25/2028	\$63,485	AA-	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 5.50%, 01/15/2028	\$56,354	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2030	\$46,611	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 4.75%, 07/04/2034	\$44,622	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 2.75%, 08/15/2032	\$43,917	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2025	\$40,950	AA-	3 Monate bis 1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 2.90%, 06/18/2026	\$38,420	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 5.50%, 04/25/2029	\$31,298	AA-	>1 Jahr	€	USA
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.00%, 11/25/2030	\$13,892	AA-	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Schwedische Staatsanleihe 3.50%, 04/08/2033	\$2,791	AAA	>1 Jahr	CHF	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 11/15/2027	\$545	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 6.50%, 07/04/2027	\$310	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.50%, 04/15/2030	\$280	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.75%, 07/15/2027	\$4	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 1.25%, 12/31/2026	\$1	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Emerging Markets Growth Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
BNP Paribas	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.50%, 07/22/2026	\$377,177	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
BNP Paribas	Deutsche Staatsanleihe 2.50%, 03/13/2025	\$377,174	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Frankreich
BNP Paribas	Französische Staatsanleihe 0.10%, 03/01/2029	\$377,155	AA-	>1 Jahr	€	Frankreich
BNP Paribas	Britische Staatsanleihe (Gilt) 4.50%, 06/07/2028	\$370,716	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
BNP Paribas	Deutsche Staatsanleihe 5.50%, 01/15/2028	\$269,428	AAA	>1 Jahr	€	Frankreich
BNP Paribas	Französische Staatsanleihe 2.50%, 09/24/2026	\$161,968	AA-	>1 Jahr	€	Frankreich
BNP Paribas	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 07/04/2029	\$83,610	AAA	>1 Jahr	€	Frankreich
BNP Paribas	Französische Staatsanleihe 1.50%, 05/25/2031	\$74,031	AA-	>1 Jahr	€	Frankreich
BNP Paribas	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2025	\$4,172	AA-	3 Monate bis 1 Jahr	€	Frankreich

* 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	Französische Staatsanleihe 2.50%, 09/24/2027	¥88,115,453	AA-	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 01/31/2028	¥88,115,439	AA	>1 Jahr	£	USA
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.38%, 10/15/2028	¥88,113,966	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 08/10/2028	¥79,462,821	AA	>1 Jahr	£	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 3.10%, 09/18/2025	¥64,201,566	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 3.25%, 01/31/2033	¥59,205,812	AA	>1 Jahr	£	USA
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 5.50%, 04/25/2029	¥22,315,606	AA-	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 1.88%, 02/15/2032	¥20,491,986	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 1.38%, 10/31/2028	¥20,491,521	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 2.50%, 03/31/2027	¥20,491,158	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 2.38%, 05/15/2029	¥20,490,818	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	Deutsche Staatsanleihe 5.50%, 01/04/2031	¥20,490,338	AAA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 1.25%, 04/30/2028	¥6,971,257	AA+	>1 Jahr	\$	USA
UBS AG	Französische Staatsanleihe 5.50%, 04/25/2029	¥4,724,643	AA-	>1 Jahr	€	Schweiz

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 0.63%, 08/15/2030	¥4,724,600	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 1.25%, 11/30/2026	¥4,724,509	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.75%, 05/25/2028	¥4,641,773	AA-	>1 Jahr	€	Schweiz
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 1.13%, 10/31/2026	¥4,417,204	AA+	>1 Jahr	\$	USA
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 5.50%, 01/15/2028	¥4,120,412	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2030	¥3,408,013	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 4.75%, 07/04/2034	¥3,262,582	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 2.75%, 08/15/2032	¥3,211,035	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2025	¥2,994,111	AA-	3 Monate bis 1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 2.90%, 06/18/2026	¥2,809,112	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.00%, 11/25/2030	¥1,015,760	AA-	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Schwedische Staatsanleihe 3.50%, 04/08/2033	¥204,068	AAA	>1 Jahr	CHF	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 11/15/2027	¥39,816	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 6.50%, 07/04/2027	¥22,701	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.50%, 04/15/2030	¥20,495	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 0.50%, 04/30/2027	¥702	AA+	>1 Jahr	\$	USA
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.75%, 07/15/2027	¥292	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	US-amerikanische Schatzanweisung 1.25%, 12/31/2026	¥79	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Angaben zur Taxonomie

Die folgenden Portfolio werden im Sinne der Offenlegungsverordnung (Sustainable Finance Disclosure Regulation, SFDR) als Finanzprodukte gemäss Artikel 6 kategorisiert. Für die Zwecke der Taxonomie-Verordnung ist zu beachten, dass die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten nicht berücksichtigen.

Dies umfasst das folgende Portfolio:

- Emerging Markets Debt Portfolio

Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungen

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Unternehmenskennung: 5493000X8WIUONC9A180

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> Ja		<input type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein	
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___ %	<input type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___ % an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___ %	<input checked="" type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt .



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale („E/S-Merkmale“) umfassten:

- **ESG-Integration:** AB stützte sich bei der Bewertung der Zielemittenten auf fundamentales Research, welches auch ESG-Faktoren berücksichtigt. Dazu kann auch die ESG-Bewertung von Aktienwerten gehören.
- **Engagement:** AB hielt die Unternehmen dazu an, Maßnahmen zu ergreifen, die zu besseren Ergebnissen bei ökologischen und sozialen Zielen sowie zu einer Verbesserung der finanziellen Ergebnisse des Emittenten und/oder des Portfolios führen können.
- **Ausschlüsse:** Das Portfolio hat die im Prospekt genannten Ausschlüsse eingehalten.

Weitere Informationen zu diesen Merkmalen finden Sie in den nachhaltigkeitsbezogenen Informationen von AB

<https://www.alliancebernstein.com/content/dam/alliancebernstein/literature/abii/regulatory/sustainability-related-disclosures-document/en/EQ-Article-8-Sustainability-related-Disclosures.pdf>

Weitere Informationen zum Stewardship-Ansatz von AB finden Sie unter:

<https://www.alliancebernstein.com/content/dam/corporate/corporate-pdfs/ABGlobalStewardship.pdf>

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

AB misst die Erzielung von ökologischen oder sozialen Merkmalen, die durch verschiedene quantitative und qualitative Methoden beworben werden, darunter der Messung von dokumentiertem ESG-Research, Engagement und relevanter Investitionsausschlüsse, vorbehaltlich zufriedenstellender Daten und Datenbeschaffung.

Im Geschäftsjahr zum 31. August 2024 wurden 85% des Portfolios so eingestuft, dass sie E/S-Merkmale bewerben, ermittelt durch ESG-Research und Engagement bei ökologischen und sozialen Themen.

Insbesondere gab es im Jahr bis zum 31. August 2024 105 Nennungen von ESG-Engagements bei 87 verschiedenen Unternehmen, die im Portfolio gehalten wurden. Bei diesen Engagements wurden 59 Diskussionen über ökologische Themen und 70 Diskussionen über soziale Themen geführt (zur Klarstellung sei angemerkt, dass die Nennung eines Engagements Diskussionen zu mehreren Themen beinhalten kann). Die am häufigsten diskutierten ökologischen oder sozialen Themen waren: CO2-Emissionen, Übergangspläne für den Klimaschutz, Personalmanagement, Diversität und Inklusion, Mitarbeitergesundheit und -sicherheit.

AB hat die Einhaltung der im Prospekt aufgeführten Ausschlüsse überwacht und bestätigt, dass sie erfüllt wurden.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Im Jahr zum 31. August 2023 wurden 85% des Portfolios so eingestuft, dass sie ökologische/soziale Merkmale bewerten, ermittelt durch ESG-Research und Engagement bei ökologischen und sozialen Themen.
- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**
k. A.
- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**
k. A.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**
k. A.
- **Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?**
k. A.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.
Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Das Portfolio hat die folgenden PAIs berücksichtigt:

- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (Nr. 10)
- Exposition gegenüber umstrittenen Waffen (Nr. 14)

Bei PAI 10 hat AB Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze mit Blick auf die vom Portfolio gehaltenen Wertpapiere überwacht.

Mit Blick auf PAI 14 hat das Portfolio umstrittene Waffen ausgeschlossen.

Nachstehend wird das Engagement des Portfolios in diesen PAI als gewichteter Durchschnitt bis zum 31. August 2024 dargestellt:

PAI-Nr.	Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Messgröße	PAI zum 31. Mai 2024 – Gewichteter Durchschnitt
PAI 10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren.	6.25%
PAI 14	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind	0.00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum, d. h. 1. September 2023 – 31. August 2024

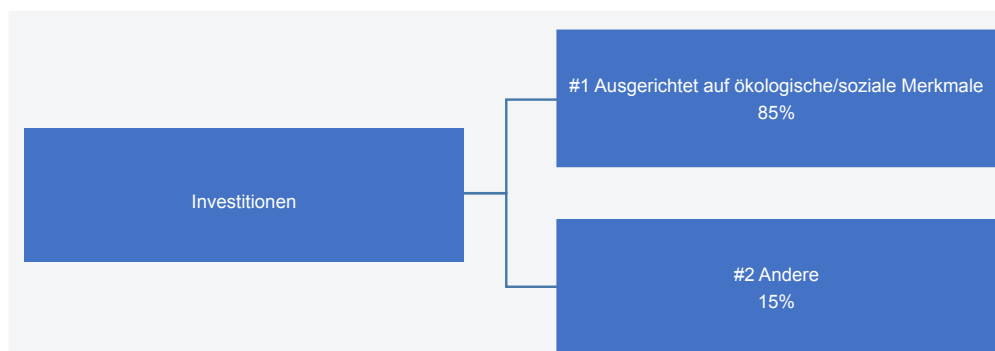
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Samsung Electronics	Informationstechnologie	7.08	Südkorea
Taiwan Semiconductor Manufacturing	Informationstechnologie	7.06	Taiwan
SK Hynix, Inc.	Informationstechnologie	4.57	Südkorea
KB Financial Group, Inc.	Finanzbranche	4.01	Südkorea
Alibaba Group Holding	Zyklische Konsumgüter	3.74	Kaimaninseln
Ping An Insurance Group of China	Finanzbranche	3.1	China
PetroChina Co., Ltd.	Energie	3.06	China
Maruti Suzuki India Ltd.	Zyklische Konsumgüter	2.75	Indien
GAIL India Ltd.	Versorger	2.74	Indien
Kunlun Energy Co., Ltd.	Versorger	2.48	Bermuda
FPT Corp.	Informationstechnologie	2.37	Vietnam
Zijin Mining Group	Grundstoffe	2.16	China
Hana Financial Group	Finanzbranche	1.9	Südkorea
King Yuan Electronics	Informationstechnologie	1.81	Taiwan
Power Grid of India	Versorgungsunternehmen	1.78	Indien



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

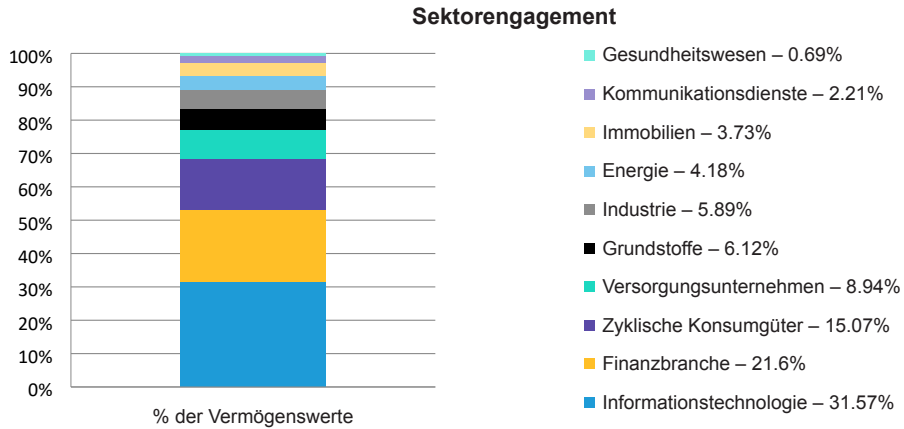
- **Wie sah die Vermögensallokation aus?**
 - #1 Ausgerichtet auf ökologische/soziale Merkmale: 85%
 - Nr. 2 Sonstige: 15%



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?



Mit Blick auf die EU-Taxonomie-Konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxoniekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

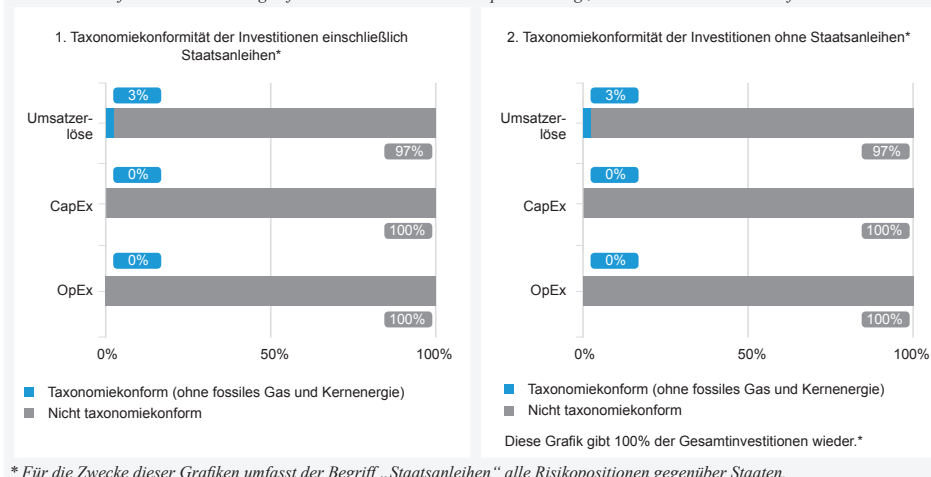
- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Berichts gibt es aktuell keine Daten, anhand derer gemessen werden könnte, ob das Portfolio in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie investiert hat, die der EU-Taxonomie entsprechen. Das Portfolio kann aufgrund der Umsetzung seiner spezifischen Anlagestrategie Investitionen mit einer marginalen Exposition bei derartigen Tätigkeiten halten, solange jedoch keine Daten externer Anbieter vorliegen, die eine Messung dieser Exposition ermöglichen, verpflichtet sich das Portfolio nicht zu einer Mindestexposition.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxoniekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxoniekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse** spiegeln den „grünen Charakter“ der Unternehmen, in die investiert wird, wider. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in hellblauer Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Obwohl das Portfolio nicht beabsichtigt, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen, wurde ein Prozentsatz der tatsächlichen Investitionen des Portfolios im Bezugszeitraum mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen gemeldet, wie von den ESA gefordert. Zum Datum dieses Berichts hat AB keinen Zugang zu geeigneten Daten, um auf der Grundlage von CapEx und OpEx angemessen zur Konformität mit der EU-Taxonomie zu berichten.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum Datum dieses Berichts hat AB keinen Zugang zu geeigneten Daten, um die Übergangstätigkeiten und die ermöglichenden Tätigkeiten korrekt zu berichten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Obwohl das Portfolio nicht beabsichtigt, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen, wurde ab dem 31. August 2023 davon ausgegangen, dass 5% des Portfolios mit der EU-Taxonomie konform sind.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

k. A.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

k. A.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Darunter fielen:

- Wertpapiere, die nach Auffassung von AB zur Erreichung des Anlageziels durch das Portfolio gehalten werden konnten, bei denen aber nicht davon ausgegangen wurde, dass sie ökologische oder soziale Merkmale bewerben, vorbehaltlich der Erfüllung der Richtlinie für gute Unternehmensführung von AB.
- Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente, die zu Liquiditätszwecken, zum Risikomanagement oder zu Zwecken der Sicherheitenverwaltung gehalten werden.
- Derivate, die für die im Prospekt genannten Zwecke verwendet werden. Engagements in Wertpapieren, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, werden unter „#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale“ erfasst.

Für diese Vermögenswerte gab es keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio bewarb ökologische oder soziale Merkmale, indem es Wertpapiere hielt, von denen AB glaubt, dass sie ökologische oder soziale Merkmale bewerben. Bei einem Wertpapier wird dann davon ausgegangen, dass es eines oder mehrere ökologische oder soziale Merkmale bewirbt, wenn die folgenden verbindlichen Elemente erfüllt sind:

- Die dokumentierte ESG-Integration wurde für den Emittenten durch ESG-Research und Engagement nachgewiesen. Zum 31. August 2024 erfüllten 90% des Portfolios diese Kriterien.
- Während des Bezugszeitraums hielt der Wertpapieremittent die Richtlinie für gute Unternehmensführung von AB, sofern zutreffend, ein.
- Das Wertpapier entsprach den Investitionsausschlüssen des Portfolios.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Das Portfolio verwendete keinen bestimmten Referenzwert zur Messung der Nachhaltigkeit oder Ermittlung von ökologischen oder sozialen Merkmalen.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

● **Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k. A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Emerging Markets Growth Portfolio

Unternehmenskennung: 54930091TH5O4X4KPV52

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja		●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein	
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%	<input type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt .



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale („E/S-Merkmale“) umfassten:

- **ESG-Integration:** AB stützte sich bei der Bewertung der Zielelementen auf fundamentales Research, welches auch ESG-Faktoren berücksichtigt. Dazu kann auch die ESG-Bewertung von Aktienwerten gehören.
- **Engagement:** AB hielt die Unternehmen dazu an, Maßnahmen zu ergreifen, die zu besseren Ergebnissen bei ökologischen und sozialen Zielen sowie zu einer Verbesserung der finanziellen Ergebnisse des Emittenten und/oder des Portfolios führen können.
- **Ausschlüsse:** Das Portfolio hat die im Prospekt genannten Ausschlüsse eingehalten.

Weitere Informationen zu diesen Merkmalen finden Sie in den nachhaltigkeitsbezogenen Informationen von AB

<https://www.alliancebernstein.com/content/dam/alliancebernstein/literature/abii/regulatory/sustainability-related-disclosures-document/en/EQ-Article-8-Sustainability-related-Disclosures.pdf>

Weitere Informationen zum Stewardship-Ansatz von AB finden Sie unter:

<https://www.alliancebernstein.com/content/dam/corporate/corporate-pdfs/ABGlobalStewardship.pdf>

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

AB misst die Erzielung von ökologischen oder sozialen Merkmalen, die durch verschiedene quantitative und qualitative Methoden beworben werden, darunter der Messung von dokumentiertem ESG-Research, Engagement und relevanter Investitionsausschlüsse, vorbehaltlich zufriedenstellender Daten und Datenbeschaffung.

Im Geschäftsjahr zum 31. August 2024 wurden 82% des Portfolios so eingestuft, dass sie E/S-Merkmale bewerben, ermittelt durch ESG-Research und Engagement bei ökologischen und sozialen Themen.

Insbesondere gab es im Jahr bis zum 31. August 2024 83 Nennungen von ESG-Engagements bei 60 verschiedenen Unternehmen, die im Portfolio gehalten wurden. Bei diesen Engagements wurden 36 Diskussionen über ökologische Themen und 58 Diskussionen über soziale Themen geführt (zur Klarstellung sei angemerkt, dass die Nennung eines Engagements Diskussionen zu mehreren Themen beinhalten kann). Die am häufigsten diskutierten ökologischen oder sozialen Themen waren: Entwicklung von Humankapital, Datenschutz und Datensicherheit, CO₂-Emissionen, Diversität und Inklusion, Personalmanagement.

AB hat die Einhaltung der im Prospekt aufgeführten Ausschlüsse überwacht und bestätigt, dass sie erfüllt wurden.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Im Geschäftsjahr zum 31. August 2023 wurden 83% des Portfolios so eingestuft, dass sie E/S-Merkmale bewerben, ermittelt durch ESG-Research und Engagement bei ökologischen und sozialen Themen.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

k. A.

● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

k. A.

● Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

k. A.

● Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?

k. A.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Das Portfolio hat die folgenden PAIs berücksichtigt:

- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (Nr. 10)
- Exposition gegenüber umstrittenen Waffen (Nr. 14)

Bei PAI 10 hat AB Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze mit Blick auf die vom Portfolio gehaltenen Wertpapiere überwacht.

Mit Blick auf PAI 14 hat das Portfolio umstrittene Waffen ausgeschlossen.

Nachstehend wird das Engagement des Portfolios in diesen PAI als gewichteter Durchschnitt bis zum 31. August 2024 dargestellt:

PAI-Nr.	Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Messgröße	PAI zum 31. Mai 2024 – Gewichteter Durchschnitt
PAI 10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren.	0.00%
PAI 14	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind	0.00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum, d. h. 1. September 2023 – 31. August 2024

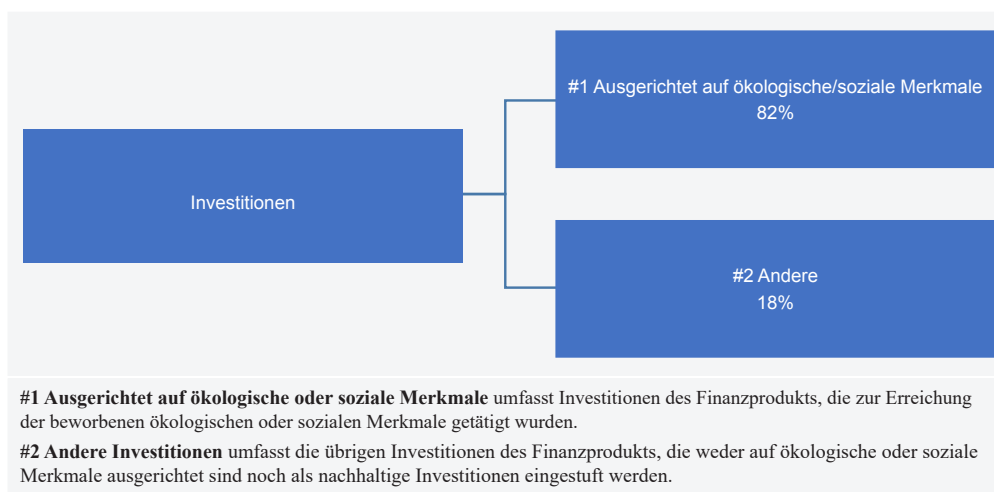
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Taiwan Semiconductor Manufacturing	Informationstechnologie	9.76	Taiwan
Samsung Electronics	Informationstechnologie	6.36	Südkorea
Tencent Holdings Ltd.	Kommunikationsdienste	5.52	Kaimaninseln
HDFC Bank Ltd.	Finanzbranche	4.67	Indien
Broadcom, Inc.	Informationstechnologie	3.21	USA
SK Hynix, Inc.	Informationstechnologie	3.12	Südkorea
MediaTek, Inc.	Informationstechnologie	3.1	Taiwan
Equatorial Energia SA	Versorger	2.65	Brasilien
AIA Group Ltd.	Finanzbranche	2.44	Hongkong
Freeport-McMoRan, Inc.	Grundstoffe	2.3	USA
Bank for Foreign Trade of Vietnam JSC	Finanzbranche	2.12	Vietnam
Al Rajhi Bank	Finanzbranche	2.1	Saudi-Arabien
Macrotech Developers Ltd.	Immobilien	2.07	Indien
Alibaba Group Holding	Zyklische Konsumgüter	2.03	Kaimaninseln
PDD Holdings, Inc.	Zyklische Konsumgüter	2.01	Kaimaninseln



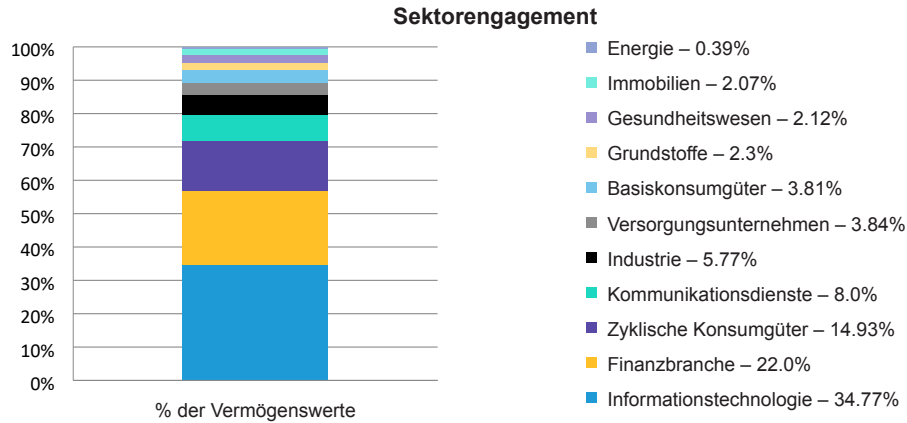
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

- **Wie sah die Vermögensallokation aus?**
 - #1 Ausgerichtet auf ökologische/soziale Merkmale: 82%
 - Nr. 2 Sonstige: 18%



● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

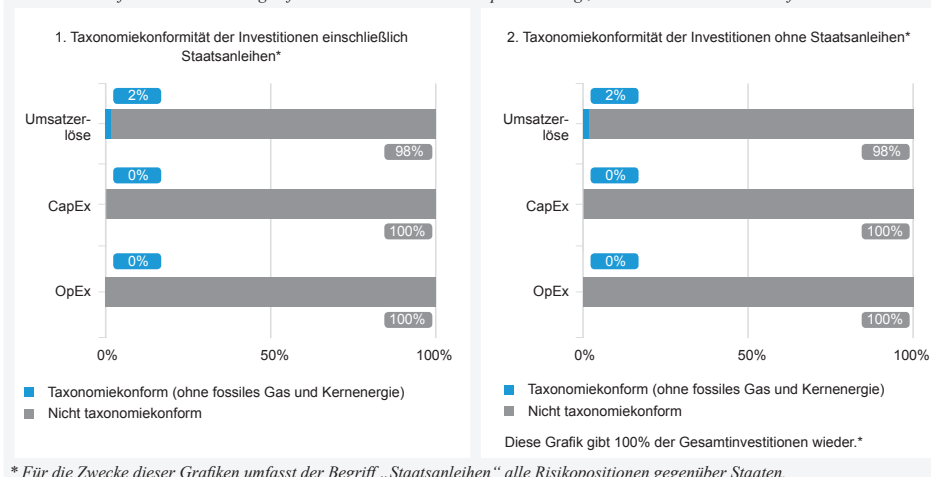
- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Berichts gibt es aktuell keine Daten, anhand derer gemessen werden könnte, ob das Portfolio in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie investiert hat, die der EU-Taxonomie entsprechen. Das Portfolio kann aufgrund der Umsetzung seiner spezifischen Anlagestrategie Investitionen mit einer marginalen Exposition bei derartigen Tätigkeiten halten, solange jedoch keine Daten externer Anbieter vorliegen, die eine Messung dieser Exposition ermöglichen, verpflichtet sich das Portfolio nicht zu einer Mindestexposition.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonmiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonmiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse** spiegeln den „grünen Charakter“ der Unternehmen, in die investiert wird, wider. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in hellblauer Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Obwohl das Portfolio nicht beabsichtigt, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen, wurde ein Prozentsatz der tatsächlichen Investitionen des Portfolios im Bezugszeitraum mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen gemeldet, wie von den ESA gefordert. Zum Datum dieses Berichts hat AB keinen Zugang zu geeigneten Daten, um auf der Grundlage von CapEx und OpEx angemessen zur Konformität mit der EU-Taxonomie zu berichten.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum Datum dieses Berichts hat AB keinen Zugang zu geeigneten Daten, um die Übergangstätigkeiten und die ermöglichenden Tätigkeiten korrekt zu berichten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Obwohl das Portfolio nicht beabsichtigt, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen, wurde ab dem 31. August 2023 davon ausgegangen, dass 6% des Portfolios mit der EU-Taxonomie konform sind.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

n. z.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

k. A.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Darunter fielen:

- Wertpapiere, die nach Auffassung von AB zur Erreichung des Anlageziels durch das Portfolio gehalten werden konnten, bei denen aber nicht davon ausgegangen wurde, dass sie ökologische oder soziale Merkmale bewerben, vorbehaltlich der Erfüllung der Richtlinie für gute Unternehmensführung von AB.
- Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente, die zu Liquiditätszwecken, zum Risikomanagement oder zu Zwecken der Sicherheitenverwaltung gehalten werden.
- Derivate, die für die im Prospekt genannten Zwecke verwendet werden. Engagements in Wertpapieren, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, werden unter „#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale“ erfasst.

Für diese Vermögenswerte gab es keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio bewarb ökologische oder soziale Merkmale, indem es Wertpapiere hielt, von denen AB glaubt, dass sie ökologische oder soziale Merkmale bewerben. Bei einem Wertpapier wurde davon ausgegangen, dass es ein oder mehrere ökologische oder soziale Merkmale bewirbt, wenn die folgenden verbindlichen Elemente erfüllt waren:

- Die dokumentierte ESG-Integration wurde für den Emittenten durch ESG-Research und Engagement nachgewiesen. Zum 31. August 2024 erfüllten 84% des Portfolios diese Kriterien.
- Während des Bezugszeitraums hielt der Wertpapieremittent die Richtlinie für gute Unternehmensführung von AB, sofern zutreffend, ein.
- Das Wertpapier entsprach den Investitionsausschlüssen des Portfolios.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Das Portfolio verwendete keinen bestimmten Referenzwert zur Messung der Nachhaltigkeit oder Ermittlung von ökologischen oder sozialen Merkmalen.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**
k. A.
- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**
k. A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Global Equity Blend Portfolio

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300ZT0SC5CC5SFG94

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___ % <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind 	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___ % an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___ %	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt .



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale („E/S-Merkmale“) umfassten:

- **ESG-Integration:** AB stützte sich bei der Bewertung der Zielemittenten auf fundamentales Research, welches auch ESG-Faktoren berücksichtigt. Dazu kann auch die ESG-Bewertung von Aktienwerten gehören.
- **Engagement:** AB hielt die Unternehmen dazu an, Maßnahmen zu ergreifen, die zu besseren Ergebnissen bei ökologischen und sozialen Zielen sowie zu einer Verbesserung der finanziellen Ergebnisse des Emittenten und/oder des Portfolios führen können.
- **Ausschlüsse:** Das Portfolio hat die im Prospekt genannten Ausschlüsse eingehalten.

Weitere Informationen zu diesen Merkmalen finden Sie in den nachhaltigkeitsbezogenen Informationen von AB

<https://www.alliancebernstein.com/content/dam/alliancebernstein/literature/abii/regulatory/sustainability-related-disclosures-document/en/EQ-Article-8-Sustainability-related-Disclosures.pdf>

Weitere Informationen zum Stewardship-Ansatz von AB finden Sie unter:

<https://www.alliancebernstein.com/content/dam/corporate/corporate-pdfs/ABGlobalStewardship.pdf>

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

AB misst die Erzielung von ökologischen oder sozialen Merkmalen, die durch verschiedene quantitative und qualitative Methoden beworben werden, darunter der Messung von dokumentiertem ESG-Research, Engagement und relevanter Investitionsausschlüsse, vorbehaltlich zufriedenstellender Daten und Datenbeschaffung.

Im Geschäftsjahr zum 31. August 2024 wurden 82% des Portfolios so eingestuft, dass sie E/S-Merkmale bewerben, ermittelt durch ESG-Research und Engagement bei ökologischen und sozialen Themen.

Insbesondere gab es im Jahr bis zum 31. August 2024 147 Nennungen von ESG-Engagements bei 90 verschiedenen Unternehmen, die im Portfolio gehalten wurden. Bei diesen Engagements wurden 68 Diskussionen über ökologische Themen und 90 Diskussionen über soziale Themen geführt (zur Klarstellung sei angemerkt, dass die Nennung eines Engagements Diskussionen zu mehreren Themen beinhalten kann). Die am häufigsten diskutierten ökologischen oder sozialen Themen waren: CO2-Emissionen, Entwicklung von Humankapital, Diversität und Inklusion, Personalmanagement, Produktsicherheit und -qualität.

AB hat die Einhaltung der im Prospekt aufgeführten Ausschlüsse überwacht und bestätigt, dass sie erfüllt wurden.

● ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Im Geschäftsjahr zum 31. August 2023 wurden 88% des Portfolios so eingestuft, dass sie E/S-Merkmale bewerben, ermittelt durch ESG-Research und Engagement bei ökologischen und sozialen Themen.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

k. A.

● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

k. A.

● Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

k. A.

● Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?

k. A.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Das Portfolio hat die folgenden PAIs berücksichtigt:

- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (Nr. 10)
- Exposition gegenüber umstrittenen Waffen (Nr. 14)

Bei PAI 10 hat AB Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze mit Blick auf die vom Portfolio gehaltenen Wertpapiere überwacht.

Mit Blick auf PAI 14 hat das Portfolio umstrittene Waffen ausgeschlossen.

Nachstehend wird das Engagement des Portfolios in diesen PAI als gewichteter Durchschnitt bis zum 31. August 2024 dargestellt:

PAI-Nr.	Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Messgröße	PAI zum 31. Mai 2024 – Gewichteter Durchschnitt
PAI 10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren.	0.50%
PAI 14	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind	0.00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum, d. h. 1. September 2023 – 31. August 2024

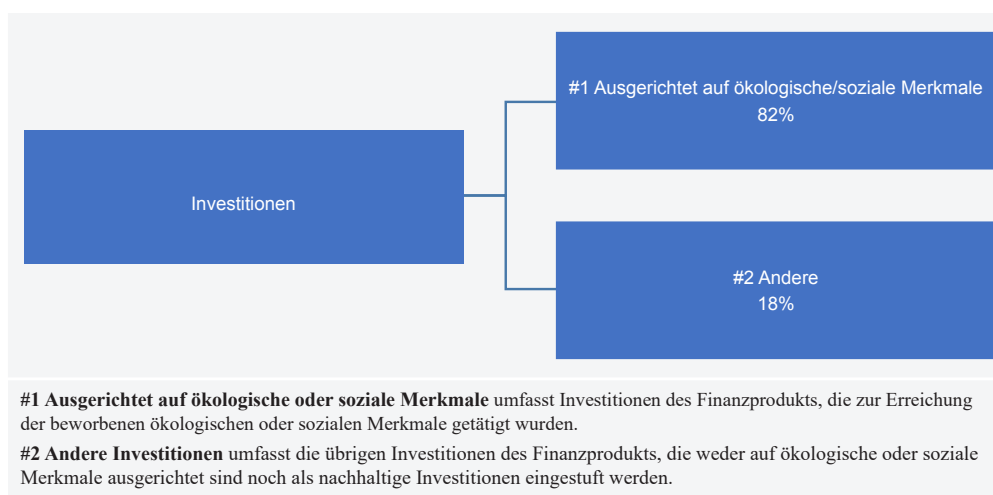
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Microsoft Corp.	Informationstechnologie	4.37	USA
Taiwan Semiconductor Manufacturing	Informationstechnologie	2.44	Taiwan
Visa, Inc.	Finanzbranche	1.76	USA
Shell PLC	Energie	1.75	Vereinigtes Königreich
NXP Semiconductors NV	Informationstechnologie	1.62	Niederlande
Waste Management, Inc.	Industrie	1.48	USA
Alphabet, Inc.	Kommunikationsdienste	1.39	USA
Oracle Corp.	Informationstechnologie	1.38	USA
Progressive Corp. (The)	Finanzbranche	1.23	USA
Wells Fargo & Co.	Finanzbranche	1.21	USA
Flex Ltd.	Informationstechnologie	1.2	Singapur
Accenture PLC	Informationstechnologie	1.19	Irland
London Stock Exchange Group	Finanzbranche	1.18	Vereinigtes Königreich
Adobe, Inc.	Informationstechnologie	1.17	USA
ICON PLC	Gesundheitswesen	1.17	Irland



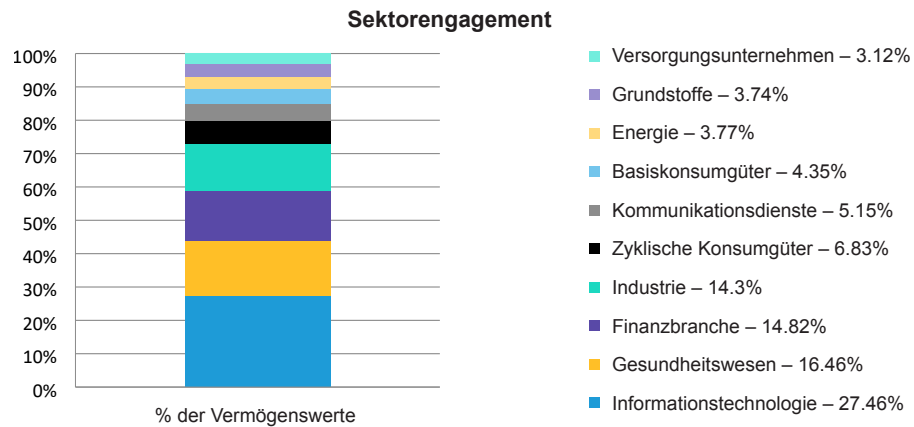
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

- **Wie sah die Vermögensallokation aus?**
 - #1 Ausgerichtet auf ökologische/soziale Merkmale: 82%
 - Nr. 2 Sonstige: 18%



● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?



Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



● Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

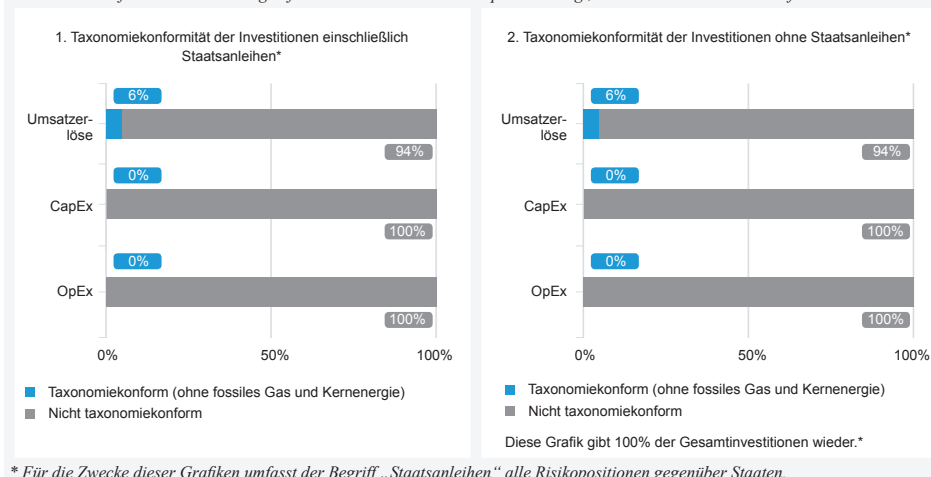
- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Berichts gibt es aktuell keine Daten, anhand derer gemessen werden könnte, ob das Portfolio in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie investiert hat, die der EU-Taxonomie entsprechen. Das Portfolio kann aufgrund der Umsetzung seiner spezifischen Anlagestrategie Investitionen mit einer marginalen Exposition bei derartigen Tätigkeiten halten, solange jedoch keine Daten externer Anbieter vorliegen, die eine Messung dieser Exposition ermöglichen, verpflichtet sich das Portfolio nicht zu einer Mindestexposition.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse** spiegeln den „grünen Charakter“ der Unternehmen, in die investiert wird, wider. - **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen - **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in hellblauer Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Obwohl das Portfolio nicht beabsichtigt, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen, wurde ein Prozentsatz der tatsächlichen Investitionen des Portfolios im Bezugszeitraum mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen gemeldet, wie von den ESA gefordert. Zum Datum dieses Berichts hat AB keinen Zugang zu geeigneten Daten, um auf der Grundlage von CapEx und OpEx angemessen zur Konformität mit der EU-Taxonomie zu berichten.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum Datum dieses Berichts hat AB keinen Zugang zu geeigneten Daten, um die Übergangstätigkeiten und die ermöglichenden Tätigkeiten korrekt zu berichten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Obwohl das Portfolio nicht beabsichtigt, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen, wurde ab dem 31. August 2023 davon ausgegangen, dass 5% des Portfolios mit der EU-Taxonomie konform sind.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

k. A.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

k. A.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Darunter fielen:

- Wertpapiere, die nach Auffassung von AB zur Erreichung des Anlageziels durch das Portfolio gehalten werden konnten, bei denen aber nicht davon ausgegangen wurde, dass sie ökologische oder soziale Merkmale bewerben, vorbehaltlich der Erfüllung der Richtlinie für gute Unternehmensführung von AB.
- Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente, die zu Liquiditätszwecken, zum Risikomanagement oder zu Zwecken der Sicherheitenverwaltung gehalten werden.
- Derivate, die für die im Prospekt genannten Zwecke verwendet werden. Engagements in Wertpapieren, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, werden unter „#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale“ erfasst.

Für diese Vermögenswerte gab es keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio bewarb ökologische oder soziale Merkmale, indem es Wertpapiere hielt, von denen AB glaubt, dass sie ökologische oder soziale Merkmale bewerben. Bei einem Wertpapier wurde davon ausgegangen, dass es ein oder mehrere ökologische oder soziale Merkmale bewirbt, wenn die folgenden verbindlichen Elemente erfüllt waren:

- Die dokumentierte ESG-Integration wurde für den Emittenten durch ESG-Research und Engagement nachgewiesen. Zum 31. August 2024 erfüllten 89% des Portfolios diese Kriterien.
- Während des Bezugszeitraums hielt der Wertpapieremittent die Richtlinie für gute Unternehmensführung von AB, sofern zutreffend, ein.
- Das Wertpapier entsprach den Investitionsausschlüssen des Portfolios.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Das Portfolio verwendete keinen bestimmten Referenzwert zur Messung der Nachhaltigkeit oder Ermittlung von ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k. A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Japan Strategic Value Portfolio

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300V153FTE4MYIJ29

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja		<input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Nein	
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%	<input type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt .
<input type="checkbox"/>		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale („E/S-Merkmale“) umfassten:

- **ESG-Integration:** AB stützte sich bei der Bewertung der Zielemittenten auf fundamentales Research, welches auch ESG-Faktoren berücksichtigt. Dazu kann auch die ESG-Bewertung von Aktienwerten gehören.
- **Engagement:** AB hielt die Unternehmen dazu an, Maßnahmen zu ergreifen, die zu besseren Ergebnissen bei ökologischen und sozialen Zielen sowie zu einer Verbesserung der finanziellen Ergebnisse des Emittenten und/oder des Portfolios führen können.
- **Ausschlüsse:** Das Portfolio hat die im Prospekt genannten Ausschlüsse eingehalten.

Weitere Informationen zu diesen Merkmalen finden Sie in den nachhaltigkeitsbezogenen Informationen von AB

<https://www.alliancebernstein.com/content/dam/alliancebernstein/literature/abii/regulatory/sustainability-related-disclosures-document/en/EQ-Article-8-Sustainability-related-Disclosures.pdf>

Weitere Informationen zum Stewardship-Ansatz von AB finden Sie unter:

<https://www.alliancebernstein.com/content/dam/corporate/corporate-pdfs/ABGlobalStewardship.pdf>

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

AB misst die Erzielung von ökologischen oder sozialen Merkmalen, die durch verschiedene quantitative und qualitative Methoden beworben werden, darunter der Messung von dokumentiertem ESG-Research, Engagement und relevanter Investitionsausschlüsse, vorbehaltlich zufriedenstellender Daten und Datenbeschaffung.

Im Geschäftsjahr zum 31. August 2024 wurden 82% des Portfolios so eingestuft, dass sie E/S-Merkmale bewerben, ermittelt durch ESG-Research und Engagement bei ökologischen und sozialen Themen.

Insbesondere gab es im Jahr bis zum 31. August 2024 55 Nennungen von ESG-Engagements bei 43 verschiedenen Unternehmen, die im Portfolio gehalten wurden. Bei diesen Engagements wurden 33 Diskussionen über ökologische Themen und 30 Diskussionen über soziale Themen geführt (zur Klarstellung sei angemerkt, dass die Nennung eines Engagements Diskussionen zu mehreren Themen beinhalten kann). Die am häufigsten diskutierten ökologischen oder sozialen Themen waren: CO2-Emissionen, Möglichkeiten im Clean-Tech-Bereich, Entwicklung von Humankapital, Personalmanagement, Mitarbeitergesundheit und -sicherheit.

AB hat die Einhaltung der im Prospekt aufgeführten Ausschlüsse überwacht und bestätigt, dass sie erfüllt wurden.

- **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**
Im Geschäftsjahr zum 31. August 2023 wurden 82% des Portfolios so eingestuft, dass sie E/S-Merkmale bewerben, ermittelt durch ESG-Research und Engagement bei ökologischen und sozialen Themen.
- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**
k. A.
- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**
k. A.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**
k. A.
- **Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?**
k. A.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.
Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Das Portfolio hat die folgenden PAIs berücksichtigt:

- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (Nr. 10)
- Exposition gegenüber umstrittenen Waffen (Nr. 14)

Bei PAI 10 hat AB Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze mit Blick auf die vom Portfolio gehaltenen Wertpapiere überwacht. Mit Blick auf PAI 14 hat das Portfolio umstrittene Waffen ausgeschlossen.

Nachstehend wird das Engagement des Portfolios in diesen PAI als gewichteter Durchschnitt bis zum 31. August 2024 dargestellt:

PAI-Nr.	Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Messgröße	PAI zum 31. Mai 2024 – Gewichteter Durchschnitt
PAI 10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren.	0.00%
PAI 14	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind	0.00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum, d. h. 1. September 2023 – 31. August 2024

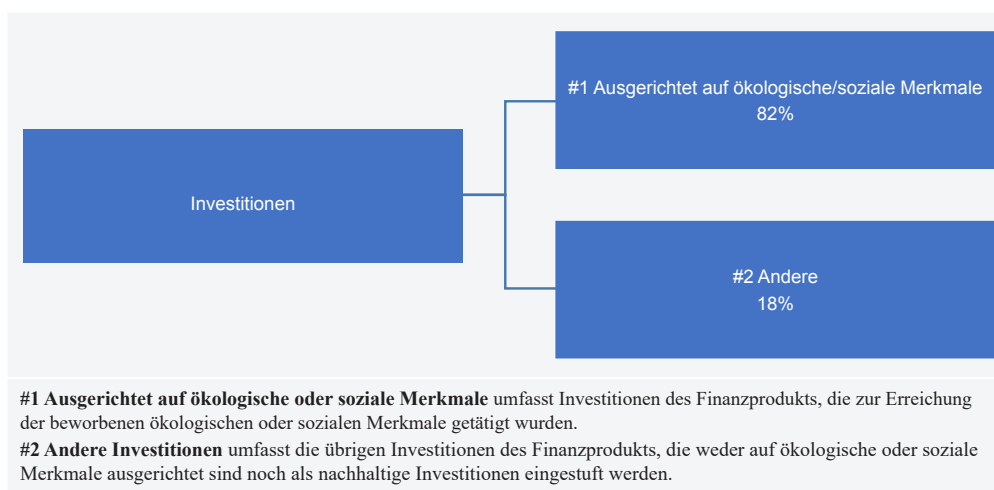
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Sumitomo Mitsui Financial Group	Finanzbranche	5.11	Japan
Konami Group Corp.	Kommunikationsdienste	3.63	Japan
Resona Holdings, Inc.	Finanzbranche	3.53	Japan
Sony Group Corp.	Zyklische Konsumgüter	3.4	Japan
Honda Motor Co., Ltd.	Zyklische Konsumgüter	3.37	Japan
Nippon Telegraph & Telephone	Kommunikationsdienste	3.25	Japan
Hitachi Ltd.	Industrie	2.94	Japan
BIPROGY, Inc.	Informationstechnologie	2.88	Japan
Tokyo Electron Ltd.	Informationstechnologie	2.84	Japan
Mitsubishi Corp.	Industrie	2.75	Japan
ENEOS Holdings, Inc.	Energie	2.62	Japan
Mitsui Fudosan Co., Ltd.	Immobilien	2.59	Japan
ASKUL Corp.	Zyklische Konsumgüter	2.38	Japan
Mitsubishi UFJ Financial Group	Finanzbranche	2.37	Japan
NEC Networks & System Integration	Informationstechnologie	2.29	Japan



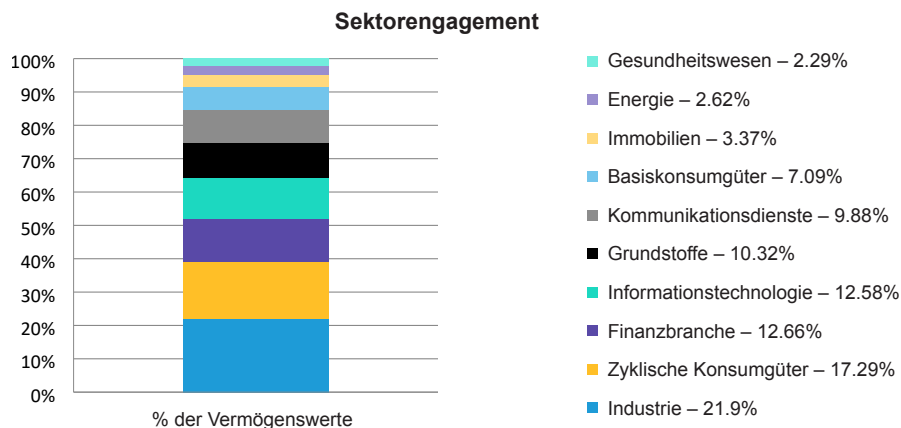
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

- **Wie sah die Vermögensallokation aus?**
 - #1 Ausgerichtet auf ökologische/soziale Merkmale: 82%
 - Nr. 2 Sonstige: 18%



● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomeikonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

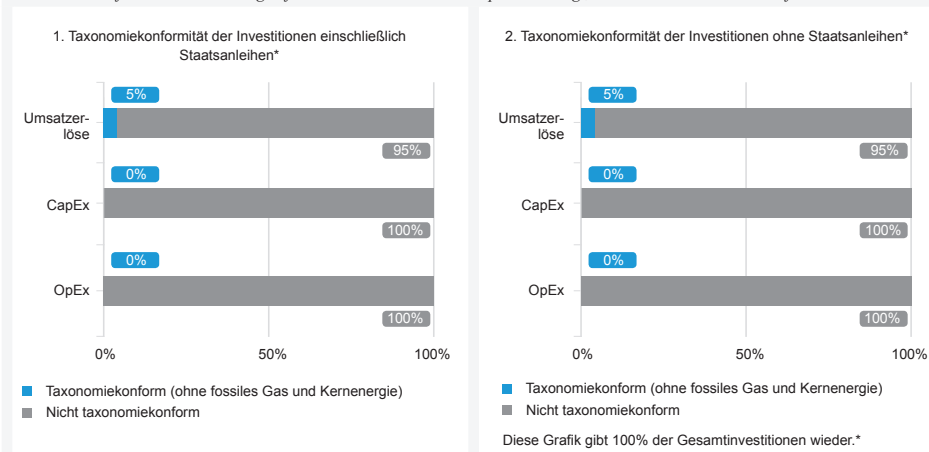
Zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Berichts gibt es aktuell keine Daten, anhand derer gemessen werden könnte, ob das Portfolio in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie investiert hat, die der EU-Taxonomie entsprechen. Das Portfolio kann aufgrund der Umsetzung seiner spezifischen Anlagestrategie Investitionen mit einer marginalen Exposition bei derartigen Tätigkeiten halten, solange jedoch keine Daten externer Anbieter vorliegen, die eine Messung dieser Exposition ermöglichen, verpflichtet sich das Portfolio nicht zu einer Mindestexposition.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomeikonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomeikonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse** spiegeln den „grünen Charakter“ der Unternehmen, in die investiert wird, wider. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-Taxonomiekonformen Investitionen in hellblauer Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

Obwohl das Portfolio nicht beabsichtigt, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen, wurde ein Prozentsatz der tatsächlichen Investitionen des Portfolios im Bezugszeitraum mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen gemeldet, wie von den ESA gefordert. Zum Datum dieses Berichts hat AB keinen Zugang zu geeigneten Daten, um auf der Grundlage von CapEx und OpEx angemessen zur Konformität mit der EU-Taxonomie zu berichten.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum Datum dieses Berichts hat AB keinen Zugang zu geeigneten Daten, um die Übergangstätigkeiten und die ermöglichenden Tätigkeiten korrekt zu berichten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Obwohl das Portfolio nicht beabsichtigt, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen, wurde ab dem 31. August 2023 davon ausgegangen, dass 6% des Portfolios mit der EU-Taxonomie konform sind.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

k. A.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

k. A.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Darunter fielen:

- Wertpapiere, die nach Auffassung von AB zur Erreichung des Anlageziels durch das Portfolio gehalten werden konnten, bei denen aber nicht davon ausgegangen wurde, dass sie ökologische oder soziale Merkmale bewerben, vorbehaltlich der Erfüllung der Richtlinie für gute Unternehmensführung von AB.
- Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente, die zu Liquiditätszwecken, zum Risikomanagement oder zu Zwecken der Sicherheitenverwaltung gehalten werden.
- Derivate, die für die im Prospekt genannten Zwecke verwendet werden. Engagements in Wertpapieren, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, werden unter „#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale“ erfasst.

Für diese Vermögenswerte gab es keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio bewarb ökologische oder soziale Merkmale, indem es Wertpapiere hielt, von denen AB glaubt, dass sie ökologische oder soziale Merkmale bewerben. Bei einem Wertpapier wurde davon ausgegangen, dass es ein oder mehrere ökologische oder soziale Merkmale bewirbt, wenn die folgenden verbindlichen Elemente erfüllt waren:

- Die dokumentierte ESG-Integration wurde für den Emittenten durch ESG-Research und Engagement nachgewiesen. Zum 31. August 2024 erfüllten 79% des Portfolios diese Kriterien.
- Während des Bezugszeitraums hielt der Wertpapieremittent die Richtlinie für gute Unternehmensführung von AB, sofern zutreffend, ein.
- Das Wertpapier entsprach den Investitionsausschlüssen des Portfolios.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Das Portfolio verwendete keinen bestimmten Referenzwert zur Messung der Nachhaltigkeit oder Ermittlung von ökologischen oder sozialen Merkmalen.

- **Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k. A.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: American Income Portfolio

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300P5SETOP8U4QS26

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja		●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein	
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%	<input type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt .



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale („E/S-Merkmale“) umfassten:

- **ESG-Integration:** AB stützte sich bei der Bewertung der Zielelementen auf fundamentales Research, welches auch ESG-Faktoren berücksichtigt. Dazu zählen Engagements, in deren Rahmen AB Emittenten ermutigte, Maßnahmen zu ergreifen, die zu besseren Ergebnissen in Bezug auf ökologische und soziale Ziele sowie zu Vorteilen für die finanziellen Ergebnisse des Emittenten und/oder des Portfolios führen können.
- **ESG-Scoring:** AB verwendete seine eigene Bewertungsmethodik, um Emittenten anhand von ESG-Faktoren zu bewerten.
- **Ausschlüsse:** Das Portfolio hat die im Prospekt genannten Ausschlüsse eingehalten.

Weitere Informationen zu diesen Merkmalen finden Sie in den nachhaltigkeitsbezogenen Informationen von AB

<https://www.alliancebernstein.com/content/dam/alliancebernstein/literature/abii/regulatory/sustainability-related-disclosures-document/en/FI-Article-8-Sustainability-related-Disclosures.pdf>

und weitere Informationen zum Stewardship-Ansatz von AB finden Sie unter:

<https://www.alliancebernstein.com/content/dam/corporate/corporate-pdfs/ABGlobalStewardship.pdf>

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

AB misst die Erreichung der beworbenen ESG-Merkmale mit verschiedenen quantitativen und qualitativen Methoden, einschließlich der Messung von dokumentiertem ESG-Research, ESG-Scoring, Engagement und relevanten Investitionsausschlüssen, vorbehaltlich zufriedenstellender Daten und Datenbeschaffung.

Zum 31. August 2024 wiesen 96% des Portfolios eine ESG-Bewertung auf der Grundlage der AB-eigenen Methodik auf, und bei 90% des Portfolios wurde auf der Grundlage dieses ESG-Research und -Scorings sowie des Engagements für ökologische und soziale Belange davon ausgegangen, dass ökologische oder soziale Merkmale beworben werden. Insbesondere gab es im Jahr bis zum 31. August 2024 203 Nennungen von ESG-Engagements bei 152 verschiedenen Unternehmen, die im Portfolio gehalten wurden. Bei diesen Engagements wurden 136 Diskussionen zu Umweltthemen und 99 zu sozialen Themen geführt (vorsorglich wird darauf hingewiesen, dass ein Engagementeintrag Diskussionen zu mehreren Themen umfassen kann). Die am häufigsten diskutierten ökologischen oder sozialen Themen waren: CO2-Emissionen, Übergangspläne für den Klimaschutz, Möglichkeiten im Bereich erneuerbare Energien, Entwicklung von Humankapital, Diversität und Inklusion.

Der ESG-Bewertungsrahmen des Portfolios wird in Prism durchgeführt, einem proprietären Rating- und Risikofaktor-Bewertungssystem, das dazu dient, die qualitativen Research-Einschätzungen unserer Analysten zu einem Emittenten in ein strukturiertes Profil umzuwandeln, das eine Reihe von Risikofaktor-Bewertungen und Kreditratings umfasst. Wesentliche ESG-Überlegungen sind expliziter Bestandteil unserer Prism-Bewertungsmethodik. Jeder Emittent mit einem ESG-Score wurde hinsichtlich der E-, S- und G-Faktoren bewertet, und der sich daraus ergebende gewichtete Durchschnitts-ESG-Score hat das Potenzial, die gesamten internen Kreditratings von AllianceBernstein zu beeinflussen. Unser länderbezogener ESG-Bewertungsrahmen erstellt einen Basiswert auf der Grundlage von mehr als 20 wesentlichen E-, S- und G-Faktoren, indem es Länder anhand einer breiten Palette von Kennzahlen vergleicht.

AB hat die Einhaltung der im Prospekt aufgeführten Ausschlüsse überwacht und bestätigt, dass sie erfüllt wurden.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Zum 31. August 2023 wiesen 99% des Portfolios eine ESG-Bewertung auf der Grundlage der AB-eigenen Methodik auf, und im Jahr bis zum 31. August 2023 wurde bei 91% des Portfolios auf der Grundlage dieses ESG-Research und -Scorings sowie des Engagements für ökologische und soziale Belange davon ausgegangen, dass ökologische oder soziale Merkmale beworben werden.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

k. A.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

k. A.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

k. A.

● **Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?**

k. A.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Das Portfolio hat die folgenden PAIs berücksichtigt:

- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (Nr. 10)
- Exposition gegenüber umstrittenen Waffen (Nr. 14)

Bei PAI 10 hat AB Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze mit Blick auf die vom Portfolio gehaltenen Wertpapiere überwacht.

Mit Blick auf PAI 14 hat das Portfolio umstrittene Waffen ausgeschlossen.

Nachstehend wird das Engagement des Portfolios in diesen PAI als gewichteter Durchschnitt bis zum 31. August 2024 dargestellt:

PAI-Nr.	Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Messgröße	PAI zum 31. Mai 2024 – Gewichteter Durchschnitt
PAI 10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren.	0.50%
PAI 14	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind	0.00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum, d. h. 1. September 2023 – 31. August 2024

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
U.S. Treasury Bonds 6.125%, 11/15/27 - 08/15/29	Treasury Bonds	3.99	USA
U.S. Treasury Bonds 6.25%, 05/15/30	Treasury Bonds	3.63	USA
U.S. Treasury Notes 4.625%, 06/30/25 - 04/30/29	Treasury Bonds	2.53	USA
U.S. Treasury Notes 4.875%, 11/30/25 - 10/31/28	Treasury Bonds	2	USA
U.S. Treasury Notes 4.125%, 10/31/27 - 07/31/28	Treasury Bonds	1.87	USA
FNMA 6.625%, 11/15/30	Agency Debentures	1.78	USA
U.S. Treasury Notes 4.00%, 02/29/28 - 06/30/28	Treasury Bonds	1.77	USA
FHLM 5.50%, 06/01/53 - 08/01/53	Agency Fixed Rate 30-Year	1.73	USA
FNMA 5.50%, 04/01/53 - 08/01/53	Agency Fixed Rate 30-Year	1.7	USA
U.S. Treasury Notes 4.125%, 01/31/25 - 11/15/32	Treasury Bonds	1.2	USA
U.S. Treasury Notes 3.50%, 01/31/28 - 02/15/33	Treasury Bonds	1.09	USA
Asia Income Opportunities Portfolio	Fonds und Investmentfonds	1.05	Luxemburg
U.S. Treasury Bonds 7.625%, 02/15/25	Treasury Bonds	0.98	USA
FHLM 6.00%, 10/01/53 - 11/01/53	Agency Fixed Rate 30-Year	0.75	USA
FNMA 7.125%, 01/15/30	Agency Fixed Rate 30-Year	0.72	USA

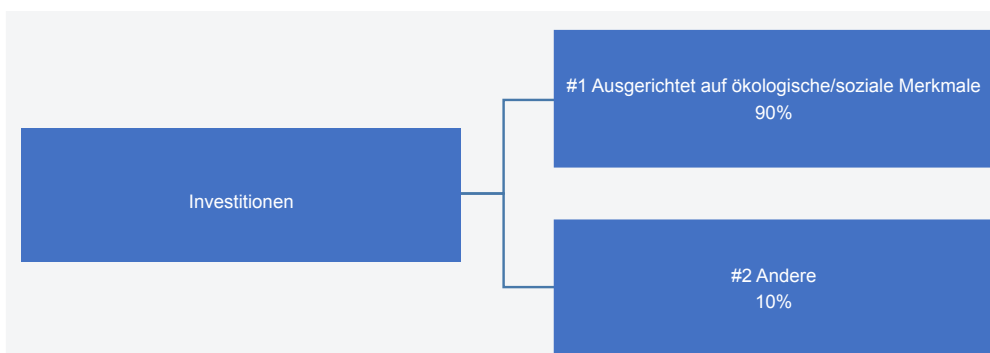


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

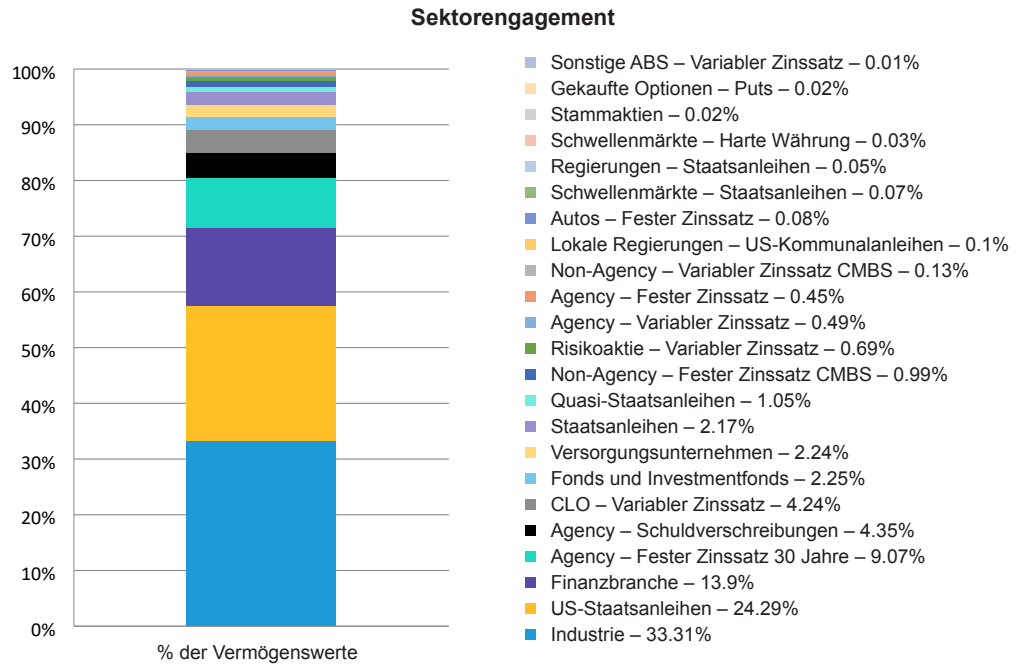
- #1 Ausgerichtet auf ökologische/soziale Merkmale: 90%
- Nr. 2 Sonstige: 10%



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?



Mit Blick auf die EU-Taxonomie-Konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

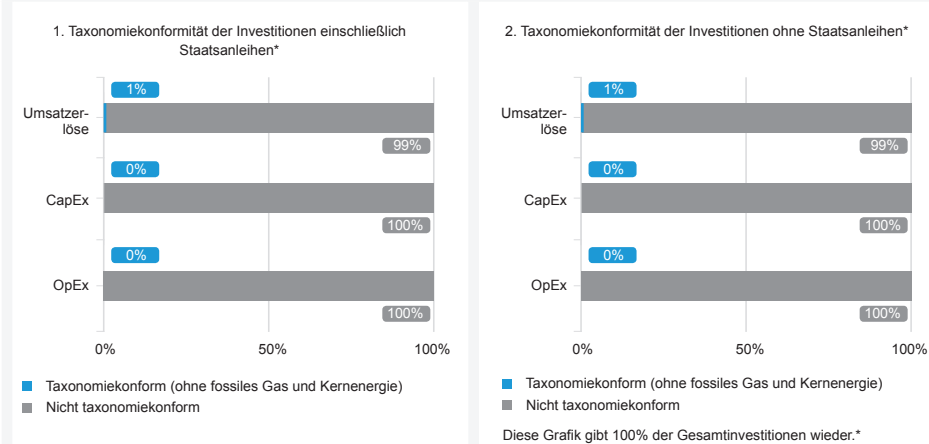
- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
- Nein

Zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Berichts gibt es aktuell keine Daten, anhand derer gemessen werden könnte, ob das Portfolio in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie investiert hat, die der EU-Taxonomie entsprechen. Das Portfolio kann aufgrund der Umsetzung seiner spezifischen Anlagestrategie Investitionen mit einer marginalen Exposition bei derartigen Tätigkeiten halten, solange jedoch keine Daten externer Anbieter vorliegen, die eine Messung dieser Exposition ermöglichen, verpflichtet sich das Portfolio nicht zu einer Mindestexposition.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der: - **Umsatzerlöse** spiegeln den „grünen Charakter“ der Unternehmen, in die investiert wird, wider. - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-Taxonomiekonformen Investitionen in hellblauer Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Obwohl das Portfolio nicht beabsichtigt, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen, wurde ein Prozentsatz der tatsächlichen Investitionen des Portfolios im Bezugszeitraum mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen gemeldet, wie von den ESA gefordert. Zum Datum dieses Berichts hat AB keinen Zugang zu geeigneten Daten, um auf der Grundlage von CapEx und OpEx angemessen zur Konformität mit der EU-Taxonomie zu berichten.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum Datum dieses Berichts hat AB keinen Zugang zu geeigneten Daten, um die Übergangstätigkeiten und die ermöglichenden Tätigkeiten korrekt zu berichten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Obwohl das Portfolio nicht beabsichtigt, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen, wurde ab dem 31. August 2023 davon ausgegangen, dass 1% des Portfolios mit der EU-Taxonomie konform sind.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

k. A.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

k. A.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Darunter fielen:

- Wertpapiere, die nach Auffassung von AB zur Erreichung des Anlageziels durch das Portfolio gehalten werden konnten, bei denen aber nicht davon ausgegangen wurde, dass sie ökologische oder soziale Merkmale bewerten, vorbehaltlich der Erfüllung der Richtlinie für gute Unternehmensführung von AB.
- Zu Absicherungszwecken eingesetzte Derivate.

Für diese Vermögenswerte gibt es keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio bewarb ökologische oder soziale Merkmale, indem es Wertpapiere hielt, von denen AB glaubt, dass sie ökologische oder soziale Merkmale bewerten. Bei einem Wertpapier wurde davon ausgegangen, dass es ein oder mehrere ökologische oder soziale Merkmale bewirbt, wenn die folgenden verbindlichen Elemente erfüllt waren:

- Die dokumentierte ESG-Integration wurde für den Emittenten durch ESG-Research und Engagement nachgewiesen.
- Der Emittent wurde anhand von ESG-Faktoren bewertet. Zum 31. August 2024 wiesen 96% des Portfolios eine ESG-Bewertung auf.
- Während des Bezugszeitraums hielt der Wertpapieremittent die Richtlinie für gute Unternehmensführung von AB, sofern zutreffend, ein.
- Das Wertpapier entsprach den Investitionsausschlüssen des Portfolios.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Das Portfolio verwendete keinen bestimmten Referenzwert zur Messung der Nachhaltigkeit oder Ermittlung von ökologischen oder sozialen Merkmalen.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k. A.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k. A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: European Income Portfolio

Unternehmenskennung (LEI-Code): 54930042M4B6EGTPOK76

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja		<input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Nein	
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : ___%	<input type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt .



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale („E/S-Merkmale“) umfassten:

- **ESG-Integration:** AB stützte sich bei der Bewertung der Zielemittenten auf fundamentales Research, welches auch ESG-Faktoren berücksichtigt. Dazu zählen Engagements, in deren Rahmen AB Emittenten ermutigte, Maßnahmen zu ergreifen, die zu besseren Ergebnissen in Bezug auf ökologische und soziale Ziele sowie zu Vorteilen für die finanziellen Ergebnisse des Emittenten und/oder des Portfolios führen können.
- **ESG-Scoring:** AB verwendete seine eigene Bewertungsmethodik, um Emittenten anhand von ESG-Faktoren zu bewerten.
- **Ausschlüsse:** Das Portfolio hat die im Prospekt genannten Ausschlüsse eingehalten.

Weitere Informationen zu diesen Merkmalen finden Sie in den nachhaltigkeitsbezogenen Informationen von AB

<https://www.alliancebernstein.com/content/dam/alliancebernstein/literature/abii/regulatory/sustainability-related-disclosures-document/en/FI-Article-8-Sustainability-related-Disclosures.pdf>

und weitere Informationen zum Stewardship-Ansatz von AB finden Sie unter:

<https://www.alliancebernstein.com/content/dam/corporate/corporate-pdfs/ABGlobalStewardship.pdf>

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

AB misst die Erreichung der beworbenen ESG-Merkmale mit verschiedenen quantitativen und qualitativen Methoden, einschließlich der Messung von dokumentiertem ESG-Research, ESG-Scoring, Engagement und relevanten Investitionsausschlüssen, vorbehaltlich zufriedenstellender Daten und Datenbeschaffung.

Zum 31. August 2024 wiesen 94% des Portfolios eine ESG-Bewertung auf der Grundlage der AB-eigenen Methodik auf, und bei 96% des Portfolios wurde auf der Grundlage dieses ESG-Research und -Scorings sowie des Engagements für ökologische und soziale Belange davon ausgegangen, dass ökologische oder soziale Merkmale beworben werden. Insbesondere gab es im Jahr bis zum 31. August 2024 92 Nennungen von ESG-Engagements bei 67 verschiedenen Unternehmen, die im Portfolio gehalten wurden. Bei diesen Engagements wurden 67 Diskussionen zu Umweltthemen und 45 zu sozialen Themen geführt (vorsorglich wird darauf hingewiesen, dass ein Engagementsbeitrag Diskussionen zu mehreren Themen umfassen kann). Die am häufigsten diskutierten ökologischen/sozialen Themen waren: CO2-Emissionen, Übergangspläne für den Klimaschutz, Anleihen mit ESG-Label, Diversität und Inklusion, Entwicklung von Humankapital.

Der ESG-Bewertungsrahmen des Portfolios wird in Prism durchgeführt, einem proprietären Rating- und Risikofaktor-Bewertungssystem, das dazu dient, die qualitativen Research-Einschätzungen unserer Analysten zu einem Emittenten in ein

strukturiertes Profil umzuwandeln, das eine Reihe von Risikofaktor-Bewertungen und Kreditratings umfasst. Wesentliche ESG-Überlegungen sind expliziter Bestandteil unserer Prism-Bewertungsmethodik. Jeder Emittent mit einem ESG-Score wurde hinsichtlich der E-, S- und G-Faktoren bewertet, und der sich daraus ergebende gewichtete Durchschnitts-ESG-Score hat das Potenzial, die gesamten internen Kreditratings von AllianceBernstein zu beeinflussen. Unser länderbezogener ESG-Bewertungsrahmen erstellt einen Basiswert auf der Grundlage von mehr als 20 wesentlichen E-, S- und G-Faktoren, indem es Länder anhand einer breiten Palette von Kennzahlen vergleicht.

AB hat die Einhaltung der im Prospekt aufgeführten Ausschlüsse überwacht und bestätigt, dass sie erfüllt wurden.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Zum 31. August 2023 wiesen 95% des Portfolios eine ESG-Bewertung auf der Grundlage der AB-eigenen Methodik auf, und im Jahr bis zum 31. August 2023 wurde bei 96% des Portfolios auf der Grundlage dieses ESG-Research und -Scorings sowie des Engagements für ökologische und soziale Belange davon ausgegangen, dass ökologische oder soziale Merkmale erworben werden.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

k. A.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

k. A.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

k. A.

● **Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?**

k. A.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Das Portfolio hat die folgenden PAIs berücksichtigt:

- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (Nr. 10)
- Exposition gegenüber umstrittenen Waffen (Nr. 14)

Bei PAI 10 hat AB Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze mit Blick auf die vom Portfolio gehaltenen Wertpapiere überwacht.

Mit Blick auf PAI 14 hat das Portfolio umstrittene Waffen ausgeschlossen.

Nachstehend wird das Engagement des Portfolios in diesen PAI als gewichteter Durchschnitt bis zum 31. August 2024 dargestellt:

PAI-Nr.	Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Messgröße	PAI zum 31. Mai 2024 – Gewichteter Durchschnitt
PAI 10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren.	0.00%
PAI 14	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind	0.00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum, d. h. 1. September 2023 – 31. August 2024 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Bundesrepublik Deutschland 6.25%, 01/04/30	Schatzanweisungen	8.37	Deutschland
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6.00%, 05/01/31	Schatzanweisungen	2.79	Italien
United Kingdom Gilt 4.625%, 01/31/34	Schatzanweisungen	1.66	Vereinigtes Königreich
Spain Government Bond 5.15%, 10/31/44	Schatzanweisungen	1.32	Spanien
ASR Nederland NV 3.375%, 05/02/49	Finanzbranche	1.11	Niederlande
Goldman Sachs Group 7.125%, 08/07/25	Finanzbranche	1.11	USA
Spain Government Bond 5.75%, 07/30/32	Schatzanweisungen	1.08	Spanien
CNP Assurances SACA 4.75%, 06/27/28	Finanzbranche	1.01	Frankreich
Allianz SE 4.252%, 07/05/52	Finanzbranche	1	Deutschland
Republic of Austria Govt Bond 2.90%, 02/20/33	Schatzanweisungen	0.94	Österreich
Bundesrepublik Deutschland 4.75%, 07/04/34	Schatzanweisungen	0.89	Deutschland
HSBC Holdings PLC 4.75%, 07/04/29	Finanzbranche	0.79	Vereinigtes Königreich
Vmed O2 UK Financing I 4.00%, 01/ 31/29	Industrie	0.79	Vereinigtes Königreich
Vodafone Group PLC 4.875%, 10/03/78	Industrie	0.72	Vereinigtes Königreich
Finland Government Bond 4.00%, 07/ 04/25	Schatzanweisungen	0.66	Finnland

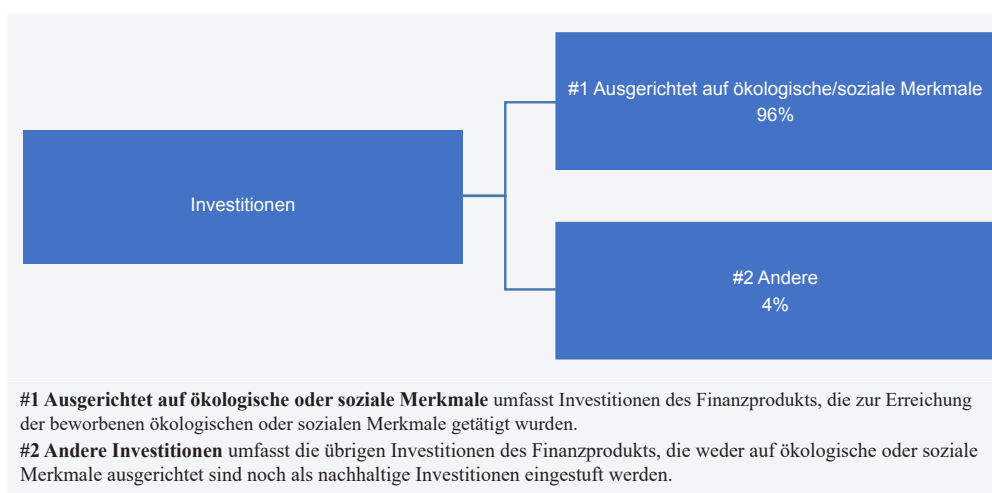


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

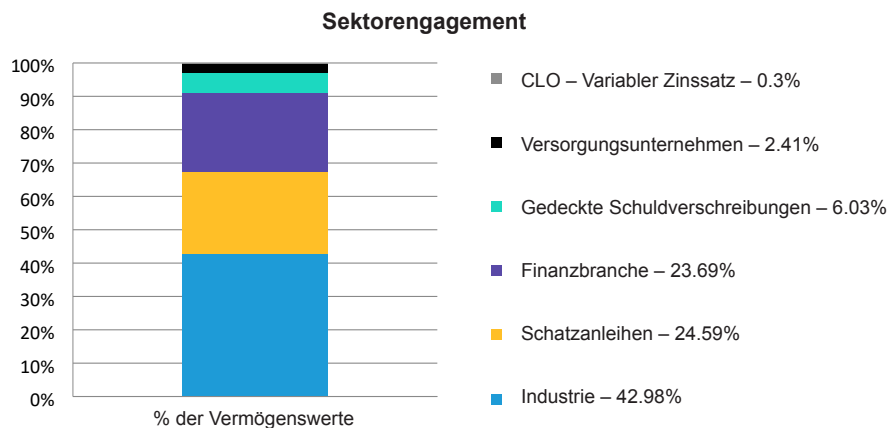
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- #1 Ausgerichtet auf ökologische/soziale Merkmale: 96%
- Nr. 2 Sonstige: 4%



● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

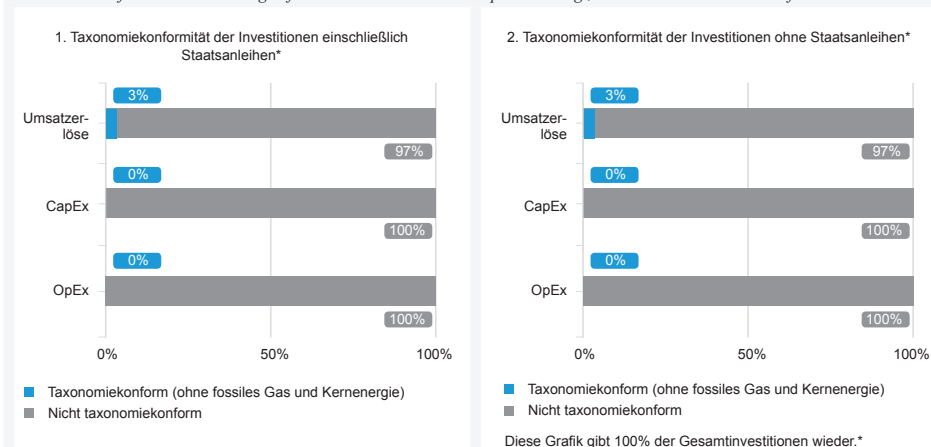
Zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Berichts gibt es aktuell keine Daten, anhand derer gemessen werden könnte, ob das Portfolio in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie investiert hat, die der EU-Taxonomie entsprechen. Das Portfolio kann aufgrund der Umsetzung seiner spezifischen Anlagestrategie Investitionen mit einer marginalen Exposition bei derartigen Tätigkeiten halten, solange jedoch keine Daten externer Anbieter vorliegen, die eine Messung dieser Exposition ermöglichen, verpflichtet sich das Portfolio nicht zu einer Mindestexposition.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in hellblauer Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Obwohl das Portfolio nicht beabsichtigt, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen, wurde ein Prozentsatz der tatsächlichen Investitionen des Portfolios im Bezugszeitraum mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen gemeldet, wie von den ESA gefordert. Zum Datum dieses Berichts hat AB keinen Zugang zu geeigneten Daten, um auf der Grundlage von CapEx und OpEx angemessen zur Konformität mit der EU-Taxonomie zu berichten.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum Datum dieses Berichts hat AB keinen Zugang zu geeigneten Daten, um die Übergangstätigkeiten und die ermöglichenden Tätigkeiten korrekt zu berichten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Obwohl das Portfolio nicht beabsichtigt, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen, wurde ab dem 31. August 2023 davon ausgegangen, dass 2% des Portfolios mit der EU-Taxonomie konform sind.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

k. A.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

k. A.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Darunter fielen:

- Wertpapiere, die nach Auffassung von AB zur Erreichung des Anlageziels durch das Portfolio gehalten werden konnten, bei denen aber nicht davon ausgegangen wurde, dass sie ökologische oder soziale Merkmale bewerben, vorbehaltlich der Erfüllung der Richtlinie für gute Unternehmensführung von AB.
- Zu Absicherungszwecken eingesetzte Derivate.

Für diese Vermögenswerte gab es keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio bewarb ökologische oder soziale Merkmale, indem es Wertpapiere hielt, von denen AB glaubt, dass sie ökologische oder soziale Merkmale bewerben. Bei einem Wertpapier wurde davon ausgegangen, dass es ein oder mehrere ökologische oder soziale Merkmale bewirbt, wenn die folgenden verbindlichen Elemente erfüllt waren:

- Die dokumentierte ESG-Integration wurde für den Emittenten durch ESG-Research und Engagement nachgewiesen.
- Der Emittent wurde anhand von ESG-Faktoren bewertet. Zum 31. August 2024 wiesen 94% des Portfolios eine ESG-Bewertung auf.
- Während des Bezugszeitraums hielt der Wertpapieremittent die Richtlinie für gute Unternehmensführung von AB, sofern zutreffend, ein.
- Das Wertpapier entsprach den Investitionsausschlüssen des Portfolios.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Das Portfolio verwendete keinen bestimmten Referenzwert für die Messung der Nachhaltigkeit oder die Festlegung ökologischer oder sozialer Merkmale.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

● **Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k. A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Global High Yield Portfolio

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300417QYQZJ6D2I52

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja		<input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Nein	
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
		<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.	



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale („E/S-Merkmale“) umfassten:

- **ESG-Integration:** AB stützte sich bei der Bewertung der Zielemittenten auf fundamentales Research, welches auch ESG-Faktoren berücksichtigt. Dazu zählen Engagements, in deren Rahmen AB Emittenten ermutigte, Maßnahmen zu ergreifen, die zu besseren Ergebnissen in Bezug auf ökologische und soziale Ziele sowie zu Vorteilen für die finanziellen Ergebnisse des Emittenten und/oder des Portfolios führen können.
- **ESG-Scoring:** AB verwendete seine eigene Bewertungsmethodik, um Emittenten anhand von ESG-Faktoren zu bewerten.
- **Ausschlüsse:** Das Portfolio hat die im Prospekt genannten Ausschlüsse eingehalten.

Weitere Informationen zu diesen Merkmalen finden Sie in den nachhaltigkeitsbezogenen Informationen von AB

<https://www.alliancebernstein.com/content/dam/alliancebernstein/literature/abii/regulatory/sustainability-related-disclosures-document/en/FI-Article-8-Sustainability-related-Disclosures.pdf>

und weitere Informationen zum Stewardship-Ansatz von AB finden Sie unter:

<https://www.alliancebernstein.com/content/dam/corporate/corporate-pdfs/ABGlobalStewardship.pdf>

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

AB misst die Erreichung der beworbenen ESG-Merkmale mit verschiedenen quantitativen und qualitativen Methoden, einschließlich der Messung von dokumentiertem ESG-Research, ESG-Scoring, Engagement und relevanten Investitionsausschlüssen, vorbehaltlich zufriedenstellender Daten und Datenbeschaffung.

Zum 31. August 2024 wiesen 94% des Portfolios eine ESG-Bewertung auf der Grundlage der AB-eigenen Methodik auf, und bei 87% des Portfolios wurde auf der Grundlage dieses ESG-Research und -Scorings sowie des Engagements für ökologische und soziale Belange davon ausgegangen, dass ökologische oder soziale Merkmale beworben werden. Insbesondere gab es im Jahr bis zum 31. August 2024 206 Nennungen von ESG-Engagements bei 161 verschiedenen Unternehmen, die im Portfolio gehalten wurden. Bei diesen Engagements wurden 132 Diskussionen zu Umweltthemen und 106 zu sozialen Themen geführt (vorsorglich wird darauf hingewiesen, dass ein Engagementsbeitrag Diskussionen zu mehreren Themen umfassen kann). Die am häufigsten diskutierten ökologischen oder sozialen Themen waren: CO₂-Emissionen, Übergangspläne für den Klimaschutz, Entwicklung von Humankapital, Personalmanagement, Möglichkeiten im Bereich erneuerbare Energien.

Der ESG-Bewertungsrahmen des Portfolios wird in Prism durchgeführt, einem proprietären Rating- und Risikofaktor-Bewertungssystem, das dazu dient, die qualitativen Research-Einschätzungen unserer Analysten zu einem Emittenten in ein strukturiertes Profil umzuwandeln, das eine Reihe von Risikofaktor-Bewertungen und Kreditratings umfasst. Wesentliche ESG-Überlegungen sind expliziter Bestandteil unserer Prism-Bewertungsmethodik. Jeder Emittent mit einem ESG-Score wurde hinsichtlich der E-, S- und G-Faktoren bewertet, und der sich daraus ergebende gewichtete Durchschnitts-ESG-Score hat das Potenzial, die gesamten internen Kreditratings von AllianceBernstein zu beeinflussen. Unser länderbezogener ESG-Bewertungsrahmen erstellt einen Basiswert auf der Grundlage von mehr als 20 wesentlichen E-, S- und G-Faktoren, indem es Länder anhand einer breiten Palette von Kennzahlen vergleicht.

AB hat die Einhaltung der im Prospekt aufgeführten Ausschlüsse überwacht und bestätigt, dass sie erfüllt wurden.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Zum 31. August 2023 wiesen 96% des Portfolios eine ESG-Bewertung auf der Grundlage der AB-eigenen Methodik auf, und im Jahr bis zum 31. August 2023 wurde bei 89% des Portfolios auf der Grundlage dieses ESG-Research und -Scorings sowie des Engagements für ökologische und soziale Belange davon ausgegangen, dass ökologische oder soziale Merkmale beworben werden.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

k. A.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

k. A.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

k. A.

● **Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?**

k. A.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Das Portfolio hat die folgenden PAIs berücksichtigt:

- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (Nr. 10)
- Exposition gegenüber umstrittenen Waffen (Nr. 14)

Bei PAI 10 hat AB Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze mit Blick auf die vom Portfolio gehaltenen Wertpapiere überwacht.

Mit Blick auf PAI 14 hat das Portfolio umstrittene Waffen ausgeschlossen.

Nachstehend wird das Engagement des Portfolios in diesen PAI als gewichteter Durchschnitt bis zum 31. August 2024 dargestellt:

PAI-Nr.	Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Messgröße	PAI zum 31. Mai 2024 – Gewichteter Durchschnitt
PAI 10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren.	0.75%
PAI 14	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind	0.00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum, d. h. 1. September 2023 – 31. August 2024 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden.

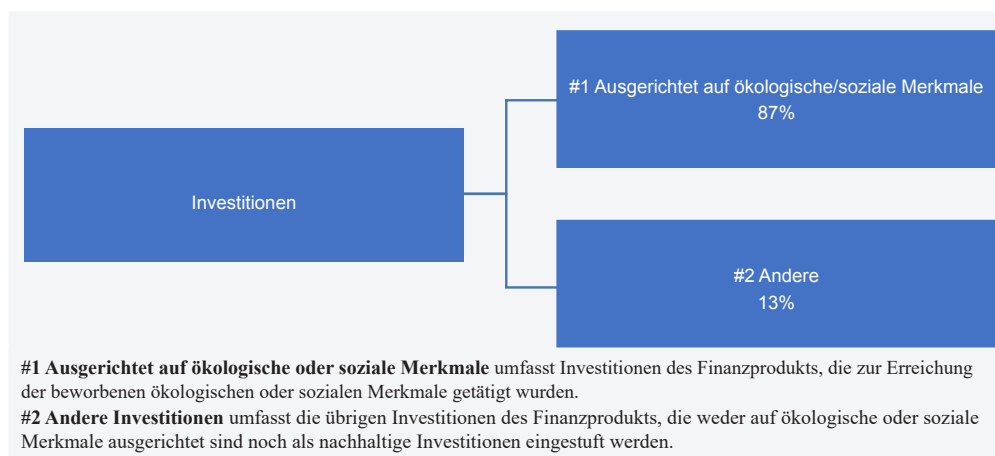
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
U.S. Treasury Bonds 6.75%, 08/15/26	Treasury Bonds	1.59	USA
Sustainable Euro High Yield Portfolio	Fonds und Investmentfonds	1.27	Luxemburg
Asia Income Opportunities Portfolio	Fonds und Investmentfonds	1.25	Luxemburg
U.S. Treasury Notes 4.625%, 09/30/28	Treasury Bonds	0.82	USA
Emerging Market Corporate Debt Portfolio	Fonds und Investmentfonds	0.76	Luxemburg
U.S. Treasury Notes 4.375%, 10/31/24 - 11/30/28	Treasury Bonds	0.52	USA
U.S. Treasury Bonds 4.00%, 11/15/52	Treasury Bonds	0.51	USA
Financial Credit Portfolio	Fonds und Investmentfonds	0.48	Luxemburg
US High Yield Portfolio	Fonds und Investmentfonds	0.46	Luxemburg
U.S. Treasury Notes 3.875%, 11/30/27 - 12/31/27	Treasury Bonds	0.46	USA
U.S. Treasury Notes 4.00%, 06/30/28	Treasury Bonds	0.44	USA
U.S. Treasury Notes 4.375%, 10/31/24 - 11/30/28	Treasury Bonds	0.41	USA
FNMA 15.70%, 01/25/29	Risikoaktie – Variabler Zinssatz	0.37	USA
U.S. Treasury Notes 4.875%, 11/30/25	Treasury Bonds	0.36	USA
Aircastle Ltd. 5.25%, 08/11/25 - 06/15/26	Finanzbranche	0.35	USA



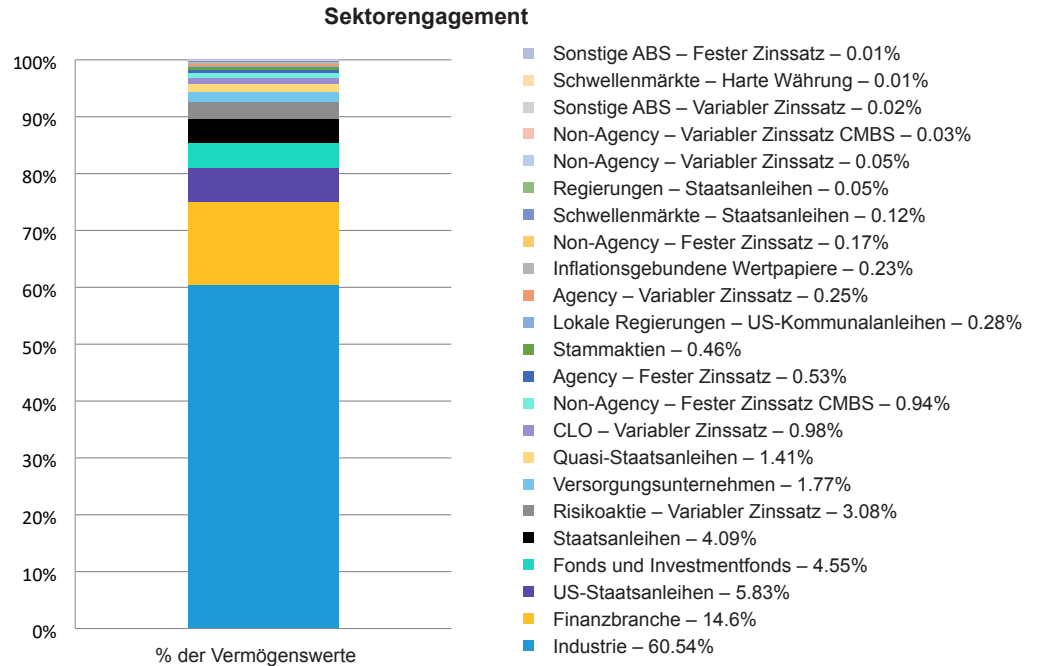
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

- **Wie sah die Vermögensallokation aus?**
 - #1 Ausgerichtet auf ökologische/soziale Merkmale: 87%
 - Nr. 2 Sonstige: 13%



● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?



Mit Blick auf die EU-Taxonomie-Konformität umfassen die Kriterien für fossiles Gas die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für Kernenergie beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

● Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?

- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

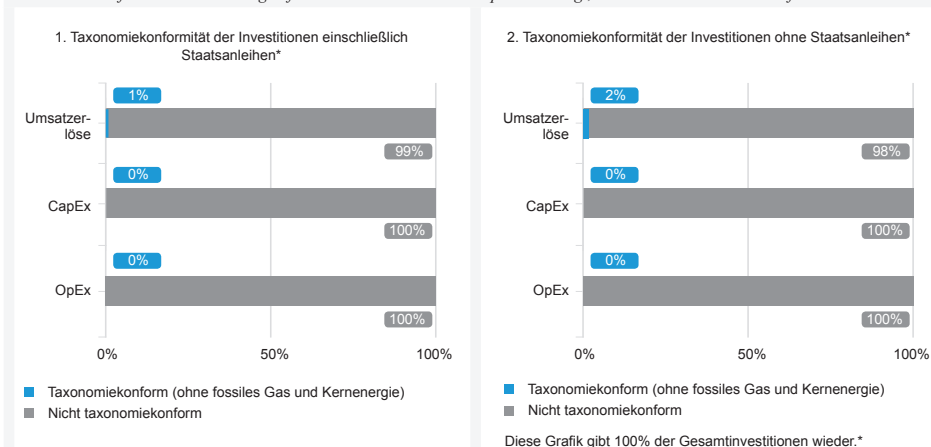
Zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Berichts gibt es aktuell keine Daten, anhand derer gemessen werden könnte, ob das Portfolio in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie investiert hat, die der EU-Taxonomie entsprechen. Das Portfolio kann aufgrund der Umsetzung seiner spezifischen Anlagestrategie Investitionen mit einer marginalen Exposition bei derartigen Tätigkeiten halten, solange jedoch keine Daten externer Anbieter vorliegen, die eine Messung dieser Exposition ermöglichen, verpflichtet sich das Portfolio nicht zu einer Mindestexposition.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in hellblauer Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Obwohl das Portfolio nicht beabsichtigt, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen, wurde ein Prozentsatz der tatsächlichen Investitionen des Portfolios im Bezugszeitraum mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen gemeldet, wie von den ESA gefordert. Zum Datum dieses Berichts hat AB keinen Zugang zu geeigneten Daten, um auf der Grundlage von CapEx und OpEx angemessen zur Konformität mit der EU-Taxonomie zu berichten.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum Datum dieses Berichts hat AB keinen Zugang zu geeigneten Daten, um die Übergangstätigkeiten und die ermöglichenden Tätigkeiten korrekt zu berichten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Obwohl das Portfolio nicht beabsichtigt, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen, wurde ab dem 31. August 2023 davon ausgegangen, dass 1% des Portfolios mit der EU-Taxonomie konform sind.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

k. A.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

k. A.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Darunter fielen:

- Wertpapiere, die nach Auffassung von AB zur Erreichung des Anlageziels durch das Portfolio gehalten werden konnten, bei denen aber nicht davon ausgegangen wurde, dass sie ökologische oder soziale Merkmale bewerben, vorbehaltlich der Erfüllung der Richtlinie für gute Unternehmensführung von AB.
- Zu Absicherungszwecken eingesetzte Derivate.

Für diese Vermögenswerte gab es keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio bewarb ökologische oder soziale Merkmale, indem es Wertpapiere hielt, von denen AB glaubt, dass sie ökologische oder soziale Merkmale bewerben. Bei einem Wertpapier wurde davon ausgegangen, dass es ein oder mehrere ökologische oder soziale Merkmale bewirbt, wenn die folgenden verbindlichen Elemente erfüllt waren:

- Die dokumentierte ESG-Integration wurde für den Emittenten durch ESG-Research und Engagement nachgewiesen.
- Der Emittent wurde anhand von ESG-Faktoren bewertet. Zum 31. August 2024 wiesen 94% des Portfolios eine ESG-Bewertung auf.
- Während des Bezugszeitraums hielt der Wertpapieremittent die Richtlinie für gute Unternehmensführung von AB, sofern zutreffend, ein.
- Das Wertpapier entsprach den Investitionsausschlüssen des Portfolios.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Das Portfolio verwendete keinen bestimmten Referenzwert für die Messung der Nachhaltigkeit oder die Festlegung ökologischer oder sozialer Merkmale.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

● **Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k. A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Mortgage Income Portfolio

Unternehmenskennung (LEI-Code): 5493000MZT8XO7PO3L08

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja		Nein	
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : ___%	<input type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/>	in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt .
<input type="checkbox"/>		<input type="checkbox"/>	mit einem sozialen Ziel



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale („E/S-Merkmale“) umfassten:

- **ESG-Integration:** AB stützte sich bei der Bewertung der Zielemittenden auf fundamentales Research, welches auch ESG-Faktoren berücksichtigt. Dazu zählen Engagements, in deren Rahmen AB Emittenten ermutigte, Maßnahmen zu ergreifen, die zu besseren Ergebnissen in Bezug auf ökologische und soziale Ziele sowie zu Vorteilen für die finanziellen Ergebnisse des Emittenten und/oder des Portfolios führen können.
- **ESG-Scoring:** AB verwendete seine eigene Bewertungsmethodik, um Emittenten anhand von ESG-Faktoren zu bewerten.
- **Ausschlüsse:** Das Portfolio hat die im Prospekt genannten Ausschlüsse eingehalten.

Weitere Informationen zu diesen Merkmalen finden Sie in den nachhaltigkeitsbezogenen Informationen von AB

<https://www.alliancebernstein.com/content/dam/alliancebernstein/literature/abii/regulatory/sustainability-related-disclosures-document/en/FI-Article-8-Sustainability-related-Disclosures.pdf>

und weitere Informationen zum Stewardship-Ansatz von AB finden Sie unter:

<https://www.alliancebernstein.com/content/dam/corporate/corporate-pdfs/ABGlobalStewardship.pdf>

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

AB misst die Erreichung der beworbenen ESG-Merkmale mit verschiedenen quantitativen und qualitativen Methoden, einschließlich der Messung von dokumentiertem ESG-Research, ESG-Scoring, Engagement und relevanten Investitionsausschlüssen, vorbehaltlich zufriedenstellender Daten und Datenbeschaffung.

Zum 31. August 2024 wiesen 89% des Portfolios eine ESG-Bewertung auf der Grundlage der AB-eigenen Methodik auf, und bei 87% des Portfolios wurde auf der Grundlage dieses ESG-Research und -Scorings sowie des Engagements für ökologische und soziale Belange davon ausgegangen, dass ökologische oder soziale Merkmale beworben werden. Insbesondere gab es im Jahr bis zum 31. August 2024 3 Nennungen von ESG-Engagements bei 2 verschiedenen Unternehmen, die im Portfolio gehalten wurden. Bei diesen Engagements wurden 2 Diskussionen zu Umweltthemen und 2 zu sozialen Themen geführt (vorsorglich wird darauf hingewiesen, dass ein Engagementeintrag Diskussionen zu mehreren Themen umfassen kann). Die am häufigsten diskutierten ökologischen/sozialen Themen waren: Anleihen mit ESG-Label, Datenschutz und Datensicherheit, Möglichkeiten im Bereich erneuerbare Energien, CO2-Emissionen, Finanzproduktsicherheit.

Der ESG-Bewertungsrahmen des Portfolios wird in Prism durchgeführt, einem proprietären Rating- und Risikofaktor-Bewertungssystem, das dazu dient, die qualitativen Research-Einschätzungen unserer Analysten zu einem Emittenten in ein strukturiertes Profil umzuwandeln, das eine Reihe von Risikofaktor-Bewertungen und Kreditratings umfasst. Wesentliche ESG-Überlegungen sind expliziter Bestandteil unserer Prism-Bewertungsmethodik. Jeder Emittent mit einem ESG-Score wurde hinsichtlich der E-, S- und G-Faktoren bewertet, und der sich daraus ergebende gewichtete Durchschnitts-ESG-Score hat das Potenzial, die gesamten internen Kreditratings von AllianceBernstein zu beeinflussen. Unser länderbezogener ESG-Bewertungsrahmen erstellt einen Basiswert auf der Grundlage von mehr als 20 wesentlichen E-, S- und G-Faktoren, indem es Länder anhand einer breiten Palette von Kennzahlen vergleicht.

AB hat die Einhaltung der im Prospekt aufgeführten Ausschlüsse überwacht und bestätigt, dass sie erfüllt wurden.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Zum 31. August 2023 wiesen 97% des Portfolios eine ESG-Bewertung auf der Grundlage der AB-eigenen Methodik auf, und im Jahr bis zum 31. August 2023 wurde bei 91% des Portfolios auf der Grundlage dieses ESG-Research und -Scorings sowie des Engagements für ökologische und soziale Belange davon ausgegangen, dass ökologische oder soziale Merkmale beworben werden.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

k. A.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

k. A.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

k. A.

● **Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?**

k. A.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Das Portfolio hat die folgenden PAIs berücksichtigt:

- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (Nr. 10)
- Exposition gegenüber umstrittenen Waffen (Nr. 14)

Bei PAI 10 hat AB Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze mit Blick auf die vom Portfolio gehaltenen Wertpapiere überwacht.

Mit Blick auf PAI 14 hat das Portfolio umstrittene Waffen ausgeschlossen.

Nachstehend wird das Engagement des Portfolios in diesen PAI als gewichteter Durchschnitt bis zum 31. August 2024 dargestellt:

PAI-Nr.	Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Messgröße	PAI zum 31. Mai 2024 – Gewichteter Durchschnitt
PAI 10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren.	0.00%
PAI 14	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind	0.00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum, d. h. 1. September 2023 – 31. August 2024 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
UMBS 6.00%, TBA	Agency Fixed Rate 30-Year	2.98	USA
GNMA 5.50%, TBA	Agency Fixed Rate 30-Year	1.77	USA
FHLM 10.70%, 01/25/50	Risikoaktie – Variabler Zinssatz	1.29	USA
GNMA 5.00%, TBA	Agency Fixed Rate 30-Year	1.22	USA
Pikes Peak CLO 8 8.686%, 07/20/34	CLO - Variabler Zinssatz	1.18	Kaimaninseln
FHLM 16.45%, 10/25/48	Risikoaktie – Variabler Zinssatz	1.12	USA
FNMA 16.20%, 01/25/29	Risikoaktie – Variabler Zinssatz	1.1	USA
FHLM 7.185%, 01/25/42	Risikoaktie – Variabler Zinssatz	0.93	USA
FHLM 15.95%, 10/25/28	Risikoaktie – Variabler Zinssatz	0.9	USA
FHLM 10.25%, 02/25/50	Risikoaktie – Variabler Zinssatz	0.88	USA
SMB Private Education Loan Trust, 01/15/53	Sonstige ABS – Fester Zinssatz	0.86	USA
Connecticut Ave Securities Trust 7.235%, 12/25/41	Risikoaktie – Variabler Zinssatz	0.86	USA
FNMA 17.70%, 09/25/28	Risikoaktie – Variabler Zinssatz	0.84	USA
Rockford Tower CLO Ltd. 7.386%, 10/20/31	CLO - Variabler Zinssatz	0.83	Kaimaninseln
FHLM 14.65%, 10/25/27	Risikoaktie – Variabler Zinssatz	0.82	USA

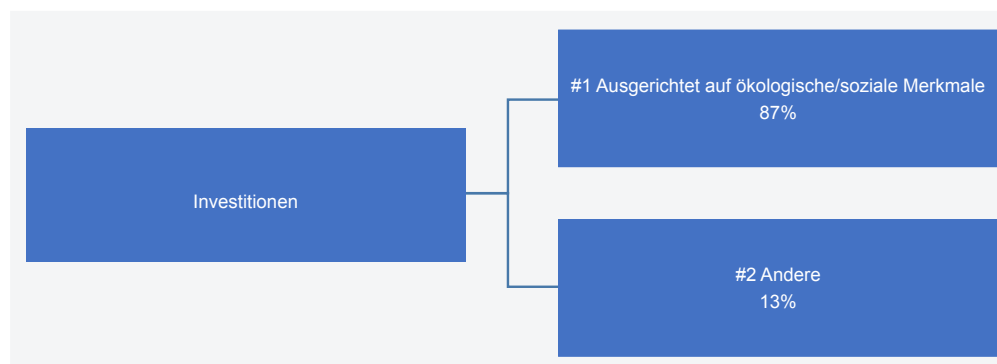


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

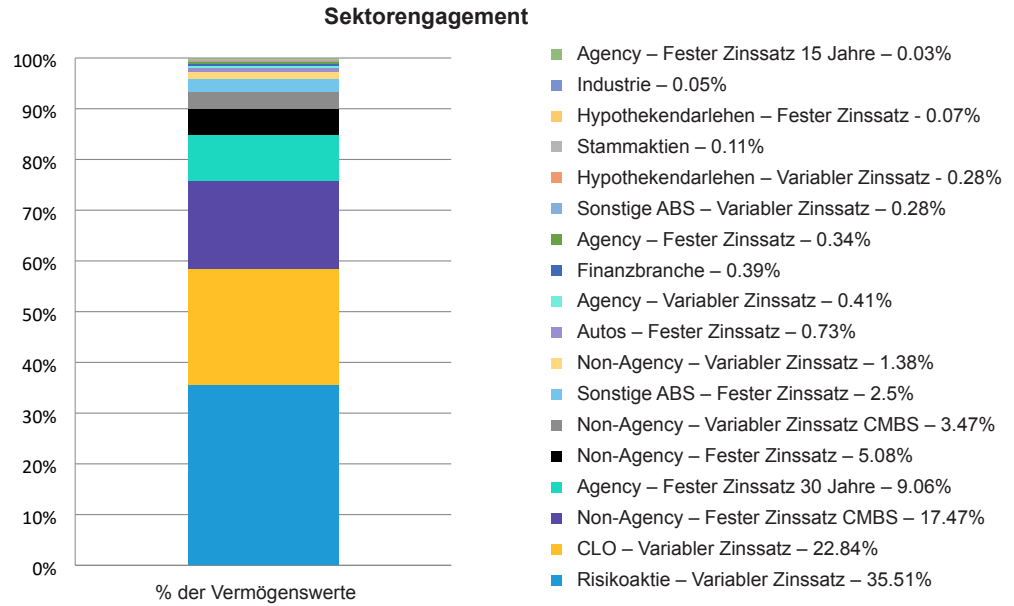
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- #1 Ausgerichtet auf ökologische/soziale Merkmale: 87%
- #2 Andere: 13%



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.
#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-Konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

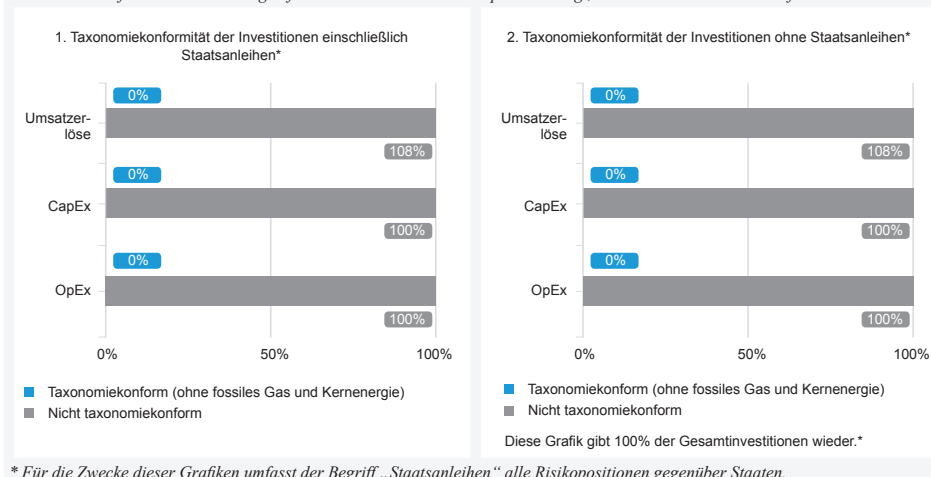
Zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Berichts gibt es aktuell keine Daten, anhand derer gemessen werden könnte, ob das Portfolio in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie investiert hat, die der EU-Taxonomie entsprechen. Das Portfolio kann aufgrund der Umsetzung seiner spezifischen Anlagestrategie Investitionen mit einer marginalen Exposition bei derartigen Tätigkeiten halten, solange jedoch keine Daten externer Anbieter vorliegen, die eine Messung dieser Exposition ermöglichen, verpflichtet sich das Portfolio nicht zu einer Mindestexposition.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in hellblauer Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Obwohl das Portfolio nicht beabsichtigt, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen, wurde ein Prozentsatz der tatsächlichen Investitionen des Portfolios im Bezugszeitraum mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen gemeldet, wie von den ESA gefordert. Zum Datum dieses Berichts hat AB keinen Zugang zu geeigneten Daten, um auf der Grundlage von CapEx und OpEx angemessen zur Konformität mit der EU-Taxonomie zu berichten.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum Datum dieses Berichts hat AB keinen Zugang zu geeigneten Daten, um die Übergangstätigkeiten und die ermöglichenden Tätigkeiten korrekt zu berichten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Obwohl das Portfolio nicht beabsichtigt, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen, wurde ab dem 31. August 2023 davon ausgegangen, dass 0% des Portfolios mit der EU-Taxonomie konform sind.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

k. A.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

k. A.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Darunter fielen:

- Wertpapiere, die nach Auffassung von AB zur Erreichung des Anlageziels durch das Portfolio gehalten werden konnten, bei denen aber nicht davon ausgegangen wurde, dass sie ökologische oder soziale Merkmale bewerben, vorbehaltlich der Erfüllung der Richtlinie für gute Unternehmensführung von AB.
- Zu Absicherungszwecken eingesetzte Derivate.

Für diese Vermögenswerte gab es keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio bewarb ökologische oder soziale Merkmale, indem es Wertpapiere hielt, von denen AB glaubt, dass sie ökologische oder soziale Merkmale bewerben. Bei einem Wertpapier wurde davon ausgegangen, dass es ein oder mehrere ökologische oder soziale Merkmale bewirbt, wenn die folgenden verbindlichen Elemente erfüllt waren:

- Die dokumentierte ESG-Integration wurde für den Emittenten durch ESG-Research und Engagement nachgewiesen.
- Der Emittent wurde anhand von ESG-Faktoren bewertet. Zum 31. August 2024 wiesen 89% des Portfolios eine ESG-Bewertung auf.
- Während des Bezugszeitraums hielt der Wertpapieremittent die Richtlinie für gute Unternehmensführung von AB, sofern zutreffend, ein.
- Das Wertpapier entsprach den Investitionsausschlüssen des Portfolios.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Das Portfolio verwendete keinen bestimmten Referenzwert für die Messung der Nachhaltigkeit oder die Festlegung ökologischer oder sozialer Merkmale.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

● **Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k. A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Short Duration Bond Portfolio

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300OWCKR7B0RK1D59

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja		<input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Nein	
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : ___%	<input type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt .



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale („E/S-Merkmale“) umfassten:

- **ESG-Integration:** AB stützte sich bei der Bewertung der Zielemittelten auf fundamentales Research, welches auch ESG-Faktoren berücksichtigt. Dazu zählen Engagements, in deren Rahmen AB Emittenten ermutigte, Maßnahmen zu ergreifen, die zu besseren Ergebnissen in Bezug auf ökologische und soziale Ziele sowie zu Vorteilen für die finanziellen Ergebnisse des Emittenten und/oder des Portfolios führen können.
- **ESG-Scoring:** AB verwendete seine eigene Bewertungsmethodik, um Emittenten anhand von ESG-Faktoren zu bewerten.
- **Ausschlüsse:** Das Portfolio hat die im Prospekt genannten Ausschlüsse eingehalten.

Weitere Informationen zu diesen Merkmalen finden Sie in den nachhaltigkeitsbezogenen Informationen von AB

<https://www.alliancebernstein.com/content/dam/alliancebernstein/literature/abii/regulatory/sustainability-related-disclosures-document/en/FI-Article-8-Sustainability-related-Disclosures.pdf>

und weitere Informationen zum Stewardship-Ansatz von AB finden Sie unter:

<https://www.alliancebernstein.com/content/dam/corporate/corporate-pdfs/ABGlobalStewardship.pdf>

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

AB misst die Erreichung der beworbenen ESG-Merkmale mit verschiedenen quantitativen und qualitativen Methoden, einschließlich der Messung von dokumentiertem ESG-Research, ESG-Scoring, Engagement und relevanten Investitionsausschlüssen, vorbehaltlich zufriedenstellender Daten und Datenbeschaffung.

Zum 31. August 2024 wiesen 99% des Portfolios eine ESG-Bewertung auf der Grundlage der AB-eigenen Methodik auf, und bei 98% des Portfolios wurde auf der Grundlage dieses ESG-Research und -Scorings sowie des Engagements für ökologische und soziale Belange davon ausgegangen, dass ökologische oder soziale Merkmale beworben werden. Insbesondere gab es im Jahr bis zum 31. August 2024 66 Nennungen von ESG-Engagements bei 42 verschiedenen Unternehmen, die im Portfolio gehalten wurden. Bei diesen Engagements wurden 46 Diskussionen zu Umweltthemen und 44 zu sozialen Themen geführt (vorsorglich wird darauf hingewiesen, dass ein Engagementsbeitrag Diskussionen zu mehreren Themen umfassen kann). Die am häufigsten diskutierten ökologischen/sozialen Themen waren: CO2-Emissionen, Anleihen mit ESG-Label, Übergangspläne für den Klimaschutz, Entwicklung von Humankapital, Diversität und Inklusion.

Der ESG-Bewertungsrahmen des Portfolios wird in Prism durchgeführt, einem proprietären Rating- und Risikofaktor-Bewertungssystem, das dazu dient, die qualitativen Research-Einschätzungen unserer Analysten zu einem Emittenten in ein strukturiertes Profil umzuwandeln, das eine Reihe von Risikofaktor-Bewertungen und Kreditratings umfasst. Wesentliche ESG-Überlegungen sind expliziter Bestandteil unserer Prism-Bewertungsmethodik. Jeder Emittent mit einem ESG-Score wurde hinsichtlich der E-, S- und G-Faktoren bewertet, und der sich daraus ergebende gewichtete Durchschnitts-ESG-Score hat das Potenzial, die gesamten internen Kreditratings von AllianceBernstein zu beeinflussen. Unser länderbezogener ESG-Bewertungsrahmen erstellt einen Basiswert auf der Grundlage von mehr als 20 wesentlichen E-, S- und G-Faktoren, indem es Länder anhand einer breiten Palette von Kennzahlen vergleicht.

AB hat die Einhaltung der im Prospekt aufgeführten Ausschlüsse überwacht und bestätigt, dass sie erfüllt wurden.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Zum 31. August 2023 wiesen 90% des Portfolios eine ESG-Bewertung auf der Grundlage der AB-eigenen Methodik auf, und im Jahr bis zum 31. August 2023 wurde bei 92% des Portfolios auf der Grundlage dieses ESG-Research und -Scorings sowie des Engagements für ökologische und soziale Belange davon ausgegangen, dass ökologische oder soziale Merkmale beworben werden.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

k. A.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

k. A.

● **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

k. A.

● **Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?**

k. A.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Das Portfolio hat die folgenden PAIs berücksichtigt:

- Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen (Nr. 10)
- Exposition gegenüber umstrittenen Waffen (Nr. 14)

Bei PAI 10 hat AB Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze mit Blick auf die vom Portfolio gehaltenen Wertpapiere überwacht.

Mit Blick auf PAI 14 hat das Portfolio umstrittene Waffen ausgeschlossen.

Nachstehend wird das Engagement des Portfolios in diesen PAI als gewichteter Durchschnitt bis zum 31. August 2024 dargestellt:

PAI-Nr.	Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen	Messgröße	PAI zum 31. Mai 2024 – Gewichteter Durchschnitt
PAI 10	Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze oder gegen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen beteiligt waren.	0.00%
PAI 14	Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)	Anteil der Investitionen in Unternehmen, in die investiert wird, die an der Herstellung oder am Verkauf von umstrittenen Waffen beteiligt sind	0.00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum, d. h. 1. September 2023 – 31. August 2024 mit dem Finanzprodukt getätigt wurden.

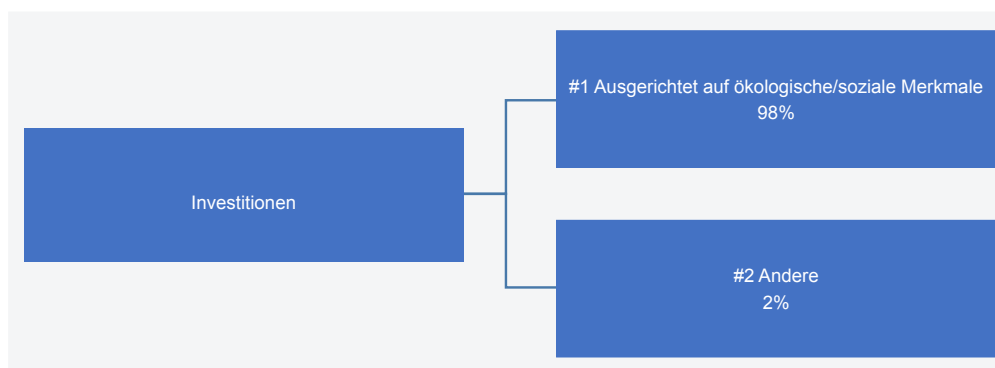
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
U.S. Treasury Notes 4.625%, 02/28/25 - 11/15/26	Schatzanweisungen	13.03	USA
U.S. Treasury Bonds 7.625%, 02/15/25	Schatzanweisungen	5.01	USA
U.S. Treasury Notes 5.00%, 10/31/25	Schatzanweisungen	4.13	USA
U.S. Treasury Bonds 7.50%, 11/15/24	Schatzanweisungen	4.07	USA
Japan Govt 20-Yr Bond 2.40%, 06/20/24	Schatzanweisungen	3.53	Japan
U.S. Treasury Notes 4.50%, 07/15/26	Schatzanweisungen	3.18	USA
U.S. Treasury Notes 4.375%, 10/31/24	Schatzanweisungen	3.05	USA
Japan Govt 20-Yr Bond 2.30%, 06/20/26	Schatzanweisungen	2.95	Japan
United Kingdom Gilt 4.125%, 01/29/27	Schatzanweisungen	2.08	Vereinigtes Königreich
U.S. Treasury Inflation Index 0.125%, 10/15/26	Inflationsgebundene Wertpapiere	1.98	USA
Canadian Government Bond 3.75%, 02/01/25	Schatzanweisungen	1.92	Kanada
U.S. Treasury Notes 4.00%, 01/15/27	Schatzanweisungen	1.86	USA
Canadian Government Bond 3.00%, 04/01/26	Schatzanweisungen	1.81	Kanada
Japan Govt 20-Yr Bond 2.10%, 03/20/24	Schatzanweisungen	1.71	Japan
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.375%, 12/15/25	Regierungen – Staatsanleihen	1.09	Deutschland



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

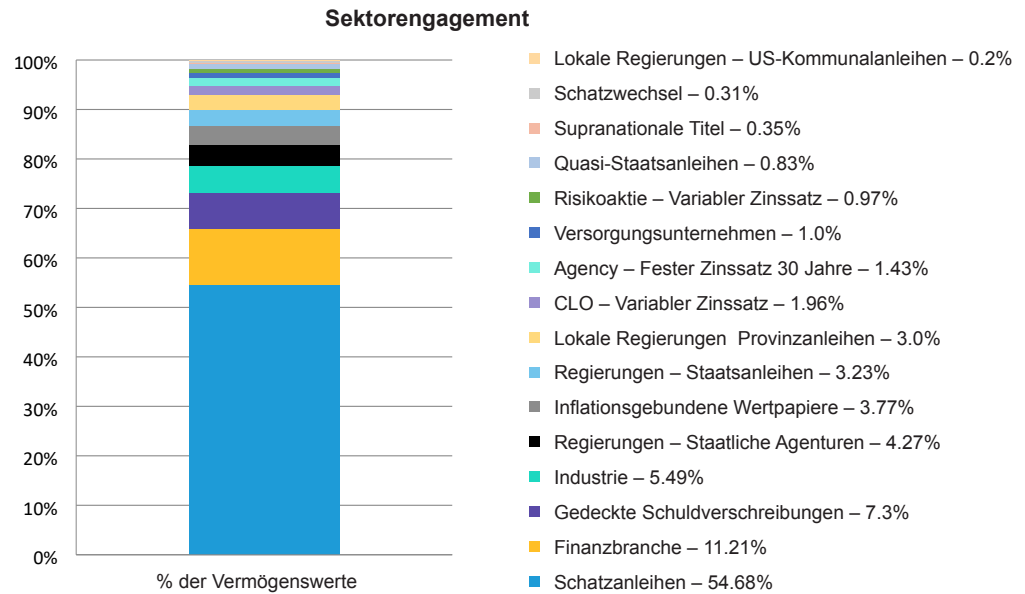
Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

- **Wie sah die Vermögensallokation aus?**
 - #1 Ausgerichtet auf ökologische/soziale Merkmale: 98%
 - Nr. 2 Sonstige: 2%



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.
#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-Konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

Zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Berichts gibt es aktuell keine Daten, anhand derer gemessen werden könnte, ob das Portfolio in Aktivitäten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie investiert hat, die der EU-Taxonomie entsprechen. Das Portfolio kann aufgrund der Umsetzung seiner spezifischen Anlagestrategie Investitionen mit einer marginalen Exposition bei derartigen Tätigkeiten halten, solange jedoch keine Daten externer Anbieter vorliegen, die eine Messung dieser Exposition ermöglichen, verpflichtet sich das Portfolio nicht zu einer Mindestexposition.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

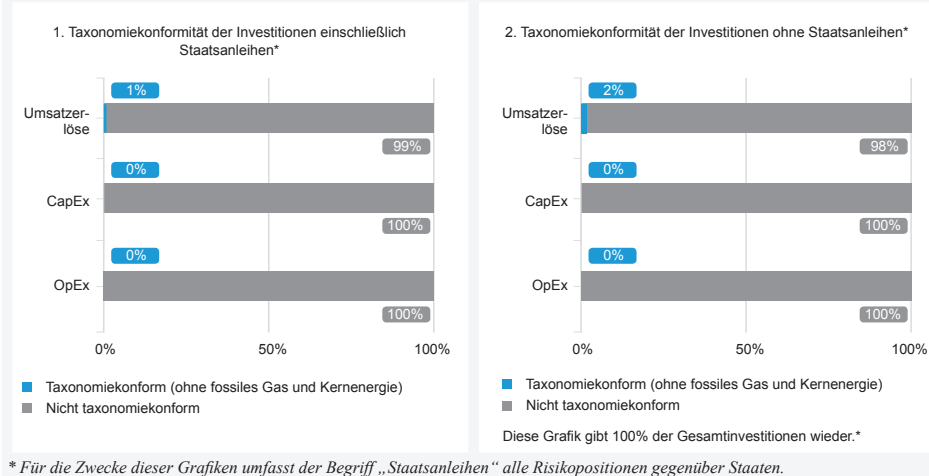
- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in hellblauer Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



Obwohl das Portfolio nicht beabsichtigt, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen, wurde ein Prozentsatz der tatsächlichen Investitionen des Portfolios im Bezugszeitraum mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen gemeldet, wie von den ESA gefordert. Zum Datum dieses Berichts hat AB keinen Zugang zu geeigneten Daten, um auf der Grundlage von CapEx und OpEx angemessen zur Konformität mit der EU-Taxonomie zu berichten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum Datum dieses Berichts hat AB keinen Zugang zu geeigneten Daten, um die Übergangstätigkeiten und die ermöglichenden Tätigkeiten korrekt zu berichten.

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Obwohl das Portfolio nicht beabsichtigt, mit der EU-Taxonomie konforme Investitionen zu tätigen, wurde ab dem 31. August 2023 davon ausgegangen, dass 1% des Portfolios mit der EU-Taxonomie konform sind.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

k. A.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

k. A.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Darunter fielen:

- Wertpapiere, die nach Auffassung von AB zur Erreichung des Anlageziels durch das Portfolio gehalten werden konnten, bei denen aber nicht davon ausgegangen wurde, dass sie ökologische oder soziale Merkmale bewerben, vorbehaltlich der Erfüllung der Richtlinie für gute Unternehmensführung von AB.
- Zu Absicherungszwecken eingesetzte Derivate.

Für diese Vermögenswerte gab es keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio bewarb ökologische oder soziale Merkmale, indem es Wertpapiere hielt, von denen AB glaubt, dass sie ökologische oder soziale Merkmale bewerben. Bei einem Wertpapier wurde davon ausgegangen, dass es ein oder mehrere ökologische oder soziale Merkmale bewirbt, wenn die folgenden verbindlichen Elemente erfüllt waren:

- Die dokumentierte ESG-Integration wurde für den Emittenten durch ESG-Research und Engagement nachgewiesen.
- Der Emittent wurde anhand von ESG-Faktoren bewertet. Zum 31. August 2024 wiesen 99% des Portfolios eine ESG-Bewertung auf.
- Während des Bezugszeitraums hielt der Wertpapieremittent die Richtlinie für gute Unternehmensführung von AB, sofern zutreffend, ein.
- Das Wertpapier entsprach den Investitionsausschlüssen des Portfolios.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Das Portfolio verwendete keinen bestimmten Referenzwert für die Messung der Nachhaltigkeit oder die Festlegung ökologischer oder sozialer Merkmale.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

● **Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

k. A.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

k. A.

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
Tokyo 100-001
Japan

VERWALTUNGSSTELLE* UND DEPOTBANK

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

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 Luxemburg

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

* Von der Verwaltungsgesellschaft delegiert.



ALLIANCEBERNSTEIN®

ABI-SRA-SW-DA-0824