

Threadneedle (Lux)

Jahresbericht und geprüfter Abschluss

Société d'Investissement à Capital Variable

31. März 2023

SICAV: Ein Luxemburger Organismus für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren gemäß Teil I des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 in der jeweils gültigen Fassung R.C.S. Luxemburg B-50.216

Inhalt

Informationen zur Gesellschaft	4	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	76
Bericht der Geschäftsleitung	5	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	77
Wertentwicklung	8	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	78
Bericht des Abschlussprüfers	9	Portfolioaufstellungen	
Abschluss:		Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	80
Konsolidierter Abschluss für Threadneedle (Lux)	12	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	89
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	13	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	95
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	15	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	104
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	17	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	109
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	19	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	116
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	20	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	123
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	22	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	127
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	23	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	133
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	24	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	137
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	25	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	146
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	26	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	150
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	28	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	152
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	30	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	155
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	31	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	170
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	32	Threadneedle (Lux) - Global Focus	172
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	34	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	174
Threadneedle (Lux) - Global Focus	35	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	177
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	37	Threadneedle (Lux) - Global Select	179
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	38	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	181
Threadneedle (Lux) - Global Select	40	Threadneedle (Lux) - American	183
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	41	Threadneedle (Lux) - American Select	184
Threadneedle (Lux) - American	43	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	185
Threadneedle (Lux) - American Select	45	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	187
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	47	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	189
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	48	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	191
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	49	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	193
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	50	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	195
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	51	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	197
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	53	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	199
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	55	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	201
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	57	Threadneedle (Lux) - European Select	203
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	58	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	205
Threadneedle (Lux) - European Select	60	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	207
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	62	Threadneedle (Lux) - Global Technology	209
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	63	Threadneedle (Lux) - UK Equities	210
Threadneedle (Lux) - Global Technology	64	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	211
Threadneedle (Lux) - UK Equities	65	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	212
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	67	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	214
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*	69	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	220
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	70	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	223
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	71	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	224
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	73	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	225
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	75	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	227

*Siehe Erläuterung 1.

Inhalt

(Fortsetzung)

Erläuterungen zum Abschluss	228
Gesamtrisiko (ungeprüft)	343
Informationen für Anteilhaber (ungeprüft)	345
Informationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)	348
Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)	349
Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)	375
Offenlegungsverordnung (SFDR) Regelmäßige Informationen (ungeprüft)	377
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond Fund	377
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	385
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	393
Threadneedle (Lux) - Global Focus	401
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	409
Threadneedle (Lux) - Global Select	418
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	426
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	434
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	443
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	452
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	461
Threadneedle (Lux) - European Select	469
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	478
Adressverzeichnis	488

Zeichnungen werden nicht auf der Grundlage der Finanzberichte entgegengenommen. Zeichnungen sind nur gültig, wenn sie auf der Grundlage des Verkaufsprospekts in Verbindung mit dem letzten Jahresbericht und dem letzten Halbjahresbericht, falls dieser nach dem Jahresbericht veröffentlicht wurde, erfolgen.

Bei diesem Bericht handelt es sich um eine Übersetzung der englischen Originalversion. Bei etwaigen Unklarheiten hat die englische Sprachversion Vorrang, soweit nach anwendbarem Recht zulässig.

Informationen zur Gesellschaft

Gesellschaft

Threadneedle (Lux)
R.C.S. Luxemburg B-50.216

Eingetragener Firmensitz

31, Z.A. Bourmicht
L-8070 Bertrange
Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsgesellschaft

Threadneedle Management Luxembourg S.A.
44, rue de la Vallée
L-2661 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsrat

Claude Kremer
Unabhängiges, nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied
Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Julie Griffiths
Global Head of Investment Risk
Columbia Threadneedle Investments
London
Vereinigtes Königreich

Annemarie Nicole Arens
Unabhängiges, nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied
Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Joseph Patrick LaRocque
Unabhängiges, nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied
Maryland
Vereinigte Staaten von Amerika

Thomas Seale
Unabhängiges, nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied
Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Bericht der Geschäftsleitung

Die Finanzmärkte erlebten volatile 12 Monate. Schon vor Russlands Invasion der Ukraine Ende Februar 2022 hatte sich der Inflationsdruck aufgrund pandemiebedingter Störungen der globalen Lieferketten erhöht. Ein weiterer Anstieg der Energiepreise aufgrund des Krieges trieb die Inflation weltweit weiter nach oben.

Nachdem die Inflationsrisiken im Laufe des Jahres 2021 größtenteils als vorübergehend heruntergespielt wurden, hoben die Zentralbanken in den USA, Großbritannien und Europa die Zinssätze im Jahr 2022 und im ersten Quartal 2023 aggressiv an. In den USA erhöhte die US-Notenbank (Fed) die Zinsen von einem Zielbereich von 0,25 % bis 0,50 % Ende März 2022 auf 4,75 % bis 5,0 %. Im Vereinigten Königreich hob die Bank of England (BoE) den Leitzins von 0,75 % auf 4,25 % an, während die Europäische Zentralbank (EZB) ebenfalls die Zinsen erhöhte. Im Gegensatz dazu beließ die Bank of Japan die Zinsen während des gesamten Jahres bei -0,1 %, hob jedoch Ende 2022 ihre Obergrenze für die Renditen 10-jähriger Staatsanleihen an. Dies wurde weithin als erster Schritt weg von ihrer ultralockeren Geldpolitik interpretiert.

Im weiteren Verlauf des Jahres 2022 belastete die Aussicht auf eine Rezession die Anlegerstimmung weiter. Lieferkettenprobleme, höhere Zinssätze und Chinas Null-Covid-Politik waren Kriterien, die allesamt zur Verlangsamung des globalen Wachstums beitrugen. Darüber hinaus ließ der Krieg in der Ukraine die ohnehin schon hohen Energiepreise in Europa deutlich nach oben schießen, was die Verbraucherbudgets drückte und die Betriebskosten der Unternehmen in die Höhe schnellen ließ. Gegen Ende des Berichtszeitraums nährten schwächere globale Wirtschaftsdaten und eine abkühlende Inflation die Hoffnung, dass wichtige Zentralbanken ihren aktuellen Zinserhöhungszyklus fast beendet haben.

Die Marktvolatilität schnellte im März nach Meldungen über den Zusammenbruch der Silicon Valley Bank (SVB) und die Probleme bei zwei anderen kleineren US-Kreditgebern in die Höhe. Die Renditen auf Staatsanleihen (die sich entgegengesetzt zum Kurs entwickeln) verzeichneten einige der größten Rückgänge seit Jahrzehnten, insbesondere bei Anleihen mit kürzerer Laufzeit, da die Anleger niedrigere Zinserhöhungen erwarteten. Die Credit Spreads (die Renditeaufschläge gegenüber „risikofreien“ Staatsanleihen) weiteten sich im März aus, nachdem sie sich in den ersten beiden Monaten des Jahres, insbesondere bei Hochzinsanleihen, verengt hatten.

Der Run auf die SVB und die anschließende Schließung und Übernahme durch die Federal Deposit Insurance Corporation ließen den gesamten Bankensektor erschauern, wobei sich die Aufmerksamkeit auf Verluste in den Anleihebeständen der Banken aufgrund höherer Zinsen konzentrierte. Bankaktien fielen, insbesondere die von schwächeren Kreditgebern, und in der Schweiz erleichterten die Regulierungsbehörden die Übernahme der in Schieflage geratenen Credit Suisse durch ihren größeren Konkurrenten UBS. Gegen Ende März stabilisierten sich die Bankaktien, und zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Berichts gibt es Anzeichen dafür, dass anfängliche Ängste vor einer Ansteckung eingedämmt wurden.

Die unmittelbarsten Auswirkungen der Krise waren niedrigere Erwartungen an den Verlauf der Zinssätze, unter anderem aufgrund der Annahme, dass sich die Zentralbanken scheuen würden, weitere Schieflagen im Bankensektor zu riskieren. Die Turbulenzen im Bankensektor, insbesondere in den USA, dürften ebenfalls zu einer Verschärfung der Kreditbedingungen führen und somit das Wachstum und die Inflation an den Rändern begrenzen. Der Präsident der Fed, Jerome Powell, erklärte, dass die Auswirkungen wahrscheinlich ähnlich wie eine Zinserhöhung sein werden.

Im Vereinigten Königreich spitzten sich im September Sorgen über die Staatsfinanzen zu, als der ehemalige Finanzminister Kwasi Kwarteng einen Mini-Haushalt mit massiven Steuersenkungen vorstellte. Die Anleger wurden durch fehlende Details zur Finanzierung und die üblichen unabhängigen Prognosen des Office for Budget Responsibility verunsichert. Infolgedessen fielen die Aktien, die Gilt-Renditen schnellten in die Höhe und das Pfund erreichte fast die Parität mit dem Dollar. Der plötzliche Anstieg der Gilt-Renditen stellte ein ernsthaftes Risiko für eine Reihe britischer Pensionsfonds dar, und die BoE griff zur Beruhigung der Märkte ein, indem sie den Ankauf von langlaufenden Gilt im Wert von bis zu 65 Milliarden Pfund zusagte. Im Oktober erholte sich das Pfund und die Gilt-Renditen fielen, als Premierministerin Liz Truss Kwasi Kwarteng als Finanzminister entließ, bevor sie selbst rasch durch Rishi Sunak ersetzt wurde. Der neue Finanzminister, Jeremy Hunt, kassierte die meisten Versprechen seines Vorgängers und kündigte Steuererhöhungen und Ausgabenkürzungen an. Bei Hunts Budget im folgenden Frühjahr gab es einige Überraschungen. Der Finanzminister erklärte, Großbritannien werde 2023 wahrscheinlich eine Rezession vermeiden und bekräftigte die Zusage der Regierung, die Inflation zu halbieren, die öffentlichen Finanzen zu stärken und das Wirtschaftswachstum anzukurbeln.

Vor diesem schwierigen Hintergrund erzielte der MSCI ACWI im 12-monatigen Berichtszeitraum in Lokalwährung eine Rendite von -5,1 %.

Unter den wichtigsten Aktienregionen schnitten Europa ohne das Vereinigte Königreich und Japan in Lokalwährungen am besten ab und erzielten positive Renditen. Diese exportlastigen Märkte wurden von der Schwäche ihrer jeweiligen Währungen gegenüber dem US-Dollar beflügelt. Gegen Ende des Berichtszeitraums profitierten auch Aktien in Europa ohne das Vereinigte Königreich von den verbesserten Konjunkturaussichten für die Region. Die britischen Aktien legten im Laufe des Jahres ebenfalls zu, unterstützt durch die Schwäche des Pfund gegenüber dem Dollar. Das erhebliche Engagement des Marktes in Energie- und Bergbauaktien erwies sich angesichts der starken Preisanstiege der zugrunde liegenden Rohstoffe infolge der Invasion Russlands ebenfalls als vorteilhaft.

Die Emerging Markets (EM) wiesen eine Underperformance auf, die zunächst durch die Schwäche chinesischer Aktien belastet wurde, da die Null-Covid-Politik Pekings die Wirtschaftsaktivität stark belastete. Die Stimmung wurde auch durch eine aufkeimende Krise im Immobiliensektor und ein anhaltendes starkes Durchgreifen der Behörden belastet. Im weiteren Verlauf des Berichtszeitraums erholten sich die chinesischen Aktien stark, als Peking die meisten seiner Covid-Beschränkungen aufhob und sein scharfes Vorgehen gegenüber großen Unternehmen zu lockern schien. Die USA entwickelten sich am schlechtesten, da sie von Phasen schwacher Wachstumswerte und einer Reihe enttäuschender Unternehmensgewinne für das letzte Quartal 2022 in Mitleidenschaft gezogen wurden.

Bei den festverzinslichen Wertpapieren stiegen die Renditen der Staatsanleihen der Kernländer während des Berichtszeitraums stark an, da die Anleger auf die starken Zinserhöhungen durch die Fed, die BoE und die EZB reagierten. Die Rendite 10-jähriger US-Staatsanleihen stieg um 113 Basispunkte (BP) und schloss im März 2023 bei 3,47 %. Die britischen und deutschen Pendanten stiegen um 188 BP auf 3,49 % bzw. um 174 BP auf 2,29 %. Die Märkte für Unternehmensanleihen waren über einen Großteil des Berichtszeitraums ebenfalls schwach, wobei die negativen Auswirkungen höherer Anleiherenditen durch breitere Credit Spreads verstärkt wurden. Die Spreads verengten sich jedoch gegenüber dem vierten Quartal 2022 vor dem Hintergrund nachlassender Sorgen über eine Straffung der Geldpolitik, wobei die globalen IG-Spreads das Berichtsjahr um fast 30 Basispunkte ausgeweitet abschlossen. Auch die Euro-HY-Spreads weiteten sich im Berichtszeitraum aus.

Bericht der Geschäftsleitung

(Fortsetzung)

Neue Positionen im Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity Fund waren im Berichtszeitraum Singapore Telecommunications Singtel, BYD und Parade Technologies. SingTel ist der größte Telekommunikationsdienstleister in Singapur und durch seine Eigentümerschaft an Optus der zweitgrößte in Australien. Das Unternehmen hält außerdem Beteiligungen an mehreren anderen Telekommunikationsunternehmen in der Region. Die Bewertung sah attraktiv aus und die Gewinne scheinen stabil zu sein, während die Aktien eine gute Dividendenrendite bieten. BYD ist ein führender Automobilhersteller in China und gemessen am Umsatz die größte Marke für Elektrofahrzeuge (EV). Das Unternehmen ist auch ein führender Anbieter von Batterien und Mobilteilen. Wir sehen das wachsende Verkaufsvolumen von BYD im Bereich Elektrofahrzeuge positiv, und dank des sich verbessernden Produktmixes des Unternehmens besteht Potenzial für höhere Margen. Die Aussichten für das taiwanische, Fabless-Halbleiterunternehmen Parade Technologies sehen vielversprechend aus, da der Abbau von Lagerbeständen zu Ende geht. Darüberhinaus stiegen wir bei der Kasikornbank ein, eine der vier größten Bankenkonzerne Thailands. Die Bank sollte von der Erholung der thailändischen Wirtschaft profitieren, da sich Schlüsselsektoren wie Tourismus und Einzelhandel nach Covid deutlich erholen. Wir verkauften unsere Titel des chinesischen Unternehmens Baidu, da wir der Ansicht waren, dass das Unternehmen von den Exportbeschränkungen für US-Halbleiter betroffen sein könnte. Abgesehen von Baidu gehörten OCBC und Sea in Singapur und Lotte Chilsung Beverage in Korea zu den weiteren Verkäufen. Diese Titel wurden verkauft, um Positionen in China wie Alibaba und China Construction Bank aufzustoßen, wo die Bewertungen angesichts der verbesserten Aussichten nach der Wiedereröffnung der Pandemie Spielraum für weitere Neubewertungen boten.

Zu den neuen Positionen im Threadneedle (Lux) - Global Select Fund gehörten während des Berichtszeitraums TotalEnergies, PepsiCo und Elevance Health. Wir bevorzugten TotalEnergies aufgrund seiner vielfältigen Produktpalette, seiner starken internationalen Präsenz und seiner robusten Marktposition. Daneben hat das Unternehmen gegenüber seinen Wettbewerbern einen Vorsprung beim Aufbau eines Geschäftsbereichs für erneuerbare Energien. PepsiCo ist einer der weltweit führenden Anbieter von Lebensmitteln, Getränken und Snacks. Wir gehen davon aus, dass das hochwertige Markenportfolio bei geringer Volatilität ein solides Umsatzwachstum erzielen wird. PepsiCo genießt zudem einen hohen Marktanteil, eine hohe Kundenbindung und eine starke Preissetzungsmacht. Elevance Health ist ein führender Anbieter von Krankenversicherungen in den USA. Das Unternehmen verfügt über eine der bekanntesten nationalen Marken und einen bedeutenden Umfang in der Branche, der dazu beiträgt, Kostenvorteile zu generieren und die Kundenbindung zu gewährleisten. Zudem sollte es von der steigenden Nachfrage nach Krankenversicherungen profitieren. Wir hielten unsere Positionen an SVB Financial und First Republic. Als führender Anbieter von Finanzierungen für die Private-Equity- und Venture-Capital-Branche verfügt die SVB über eine breite Palette von Wettbewerbsvorteilen und bot ein differenziertes Bankengagement für das Portfolio. Da die Herausforderungen im Technologiesektor und neue Finanzierungsrunden jedoch ausfielen, erfuhr die Bank einen Abfluss von Einlagen, was ein potenzielles Liquiditätsrisiko in der Bilanz zur Folge hatte und zu den Ereignissen im März führte. Auch der Ausfall der SVB und der daraus resultierende Vertrauensverlust bei regionalen US-Banken wirkten sich auf die First Republic aus. Wir verkauften unsere Anteile an First Republic Mitte März vor dem Beinahe-Zusammenbruch und der anschließenden erzwungenen Übernahme durch JPMorgan im April. Wir verkauften auch Samsung Electronics nach der starken Performance der Aktie und nutzten die Erlöse, um eine Position in Micron Technology aufzubauen, die ein überlegenes Risiko-Rendite-Profil aufweist.

Im Threadneedle (Lux) - Global Focus Fund eröffneten wir im Berichtszeitraum eine Reihe von Positionen, darunter HDFC Bank, Legrand und Waste Connections. Wir kauften die führende indische Privatbank HDFC, nachdem wir die ICICI Bank verkauft hatten, da wir unser Engagement in diesem Sektor auf eine einzige Position konzentrieren wollten und wir sind der Meinung, dass HDFC eine bessere langfristige Kreditvergabe bilanz aufweist. Legrand ist ein führender Anbieter von Niederspannungsgeräten und profitiert von einem sehr hohen Marktanteil, insbesondere in Märkten mit geringem Wachstum wie Italien und Frankreich. Wir bevorzugten Legrand aufgrund seiner internationalen Präsenz, die sich unserer Ansicht nach im Laufe der Zeit, insbesondere in den USA und den Schwellenmärkten, aufbauen wird. Waste Connections ist ein nordamerikanisches integriertes Abfalldienstleistungsunternehmen, das Abfallsammlungs-, Transfer-, Entsorgungs- und Recyclingdienstleistungen anbietet. Das Unternehmen hat in den USA eine führende Marktposition inne und weist unter seinen Mitbewerbern die beste langfristige Erfolgsbilanz auf. Das Unternehmen verfolgt außerdem eine solide Betriebsstrategie, die sich an Gemeinden in Vororten und ländlichen Gemeinschaften anstelle von Städten richtet, was ihm neben Größen- und Kostenvorteilen mehr Verhandlungsmacht verleiht. Die Verkäufe umfassten Amazon, Adobe und Tryg.

Zu den neuen Positionen im Threadneedle (Lux) - Global Equity Income Fund gehörten AbbVie, PNC und SMC. AbbVie erforscht und entwickelt pharmazeutische Produkte. Das Unternehmen verzeichnet ein starkes Wachstum bei neuen Produkten, angeführt von zwei führenden Medikamenten: dem Psoriasis-Medikament Skyrizi und dem Entzündungsmedikament Rinvoq. AbbVie hat auch eine dominante Position im Ästhetikmarkt und ist damit ein weiterer Motor für Wachstum und Diversifizierung. PNC ist ein gut geführtes, diversifiziertes Finanzdienstleistungsunternehmen mit einer starken und wachsenden Präsenz in den USA. Das Unternehmen profitiert von seiner breiten Produktpalette, seiner robusten Technologie und seinem langjährigen Ruf. Die Aktie weist auch eine hohe Dividendenrendite auf. SMC ist der weltweit größte Hersteller pneumatischer Geräte. Die Nachfrage nach seinen Produkten wächst, insbesondere in der Automatisierungsbranche. SMC profitiert außerdem von einer starken Marktposition, einer breiten Produktpalette, Vertriebsreichweite und kurzen Bearbeitungszeiten. Zu den Verkäufen zählte Valero Energy, da wir unser zyklisches Engagement reduzieren wollten. Wir verkauften auch Crown Castle, weil wir glauben, dass es für das Unternehmen schwierig sein wird, sein Dividendenwachstum in einem inflationären Umfeld aufrechtzuerhalten. Zu den sonstigen Verkäufen gehörten Disco Corporation und Manulife Financial.

Im Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies Fund eröffneten wir neue Positionen in Nemetschek und Rémy Cointreau. Nemetschek ist ein weltweiter Marktführer in mehreren Regionen und Segmenten im Baugewerbe. Die Gesellschaft verfügt über eine gut diversifizierte Umsatzbasis, ein starkes und erfahrenes Managementteam sowie eine gut etablierte Marktposition. Wir bevorzugten Nemetschek auch aufgrund seiner Führungsrolle in puncto Innovation. Rémy Cointreau produziert und vertreibt weltweit erstklassige Weine und Spirituosen. Das hervorragende Markenportfolio von Rémy bietet ihm einen Wettbewerbsvorteil und eine starke Preismacht. Wir sind der Ansicht, dass das Unternehmen gut positioniert ist, um von der Verlagerung der Verbraucherpräferenzen hin zu exklusiven Marken zu profitieren. Außerdem eröffneten wir eine Position in Acushnet, einem Unternehmen, das Golfprodukte herstellt und vertreibt. Acushnet dürfte von der steigenden Nachfrage nach Golfbällen profitieren. Zudem weist das Unternehmen einen gesunden Auftragsbestand, schlanke Lagerbestände in den Vertriebskanälen und ein allmähliches Wachstum der Produktionsmengen auf. Wir verkauften Evoqua Water Technologies gewinnbringend, nachdem das Unternehmen ein Übernahmeangebot mit deutlichem Preisaufschlag von Xylem erhalten hatte. Weitere Verkäufe waren Ritchie Bros Auctioneers und Inter Parfums.

Zu den neuen Positionen im Threadneedle (Lux) - UK Equities Fund gehörten SSE, Ashtead und Spectris. SSE ist ein führender Entwickler und Betreiber von erneuerbaren Energien und kohlenstoffarmer Infrastruktur bei der Stromübertragung und -verteilung. Die Gesellschaft betreibt ein ausgewogenes

Bericht der Geschäftsleitung

(Fortsetzung)

Portfolio von Vermögenswerten, darunter Stromnetze und erneuerbare Energien, sodass sie sich unter volatilen Marktbedingungen gut entwickeln kann. Der Ausrüstungsvermieter Ashtead wurde zu einer attraktiven Bewertung gehandelt; das Unternehmen verfügt außerdem über starke Fundamentaldaten und verzeichnet ein Umsatzwachstum, das durch Bolt-on-Akquisitionen verstärkt wird. Wir eröffneten erneut eine Position in Spectris (nachdem wir die Aktie Ende 2021 zuvor mit Gewinn verkauft hatten), nachdem das Unternehmen seine Omega-Sparte zu einem über den Erwartungen liegenden Preis verkauft hatte. Das verbleibende Geschäft der Gesellschaft ist von ausgezeichneter Qualität und weist eine Nettoliquidität auf. Wir eröffneten zu Beginn des Berichtszeitraums auch eine Position im Softwareunternehmen AVEVA. Die Aktien stiegen später nach einem Übernahmeangebot von Schneider Electric, und wir verkauften die Aktie anschließend mit Gewinn. Weitere Verkäufe waren Smiths Group, Imperial Brands, BAE und Hunting.

Im Threadneedle (Lux) - UK Equity Income Fund eröffneten wir Positionen in Smith & Nephew, Hikma Pharmaceuticals und Travis Perkins. Die Aktien des Medizintechnikherstellers Smith & Nephew waren im Vergleich zu seinen Mitbewerbern und dem potenziellen Wert seiner Gesamtparten unterbewertet. Da das Unternehmen neue Produkte auf den Markt bringt, sind wir hinsichtlich der mittel- bis langfristigen Aussichten des Unternehmens optimistisch. Hikma ist der führende Akteur im Bereich Injektionsmittel und Markenprodukte, der hohe Eintrittsbarrieren und ein starkes Wachstumspotenzial aufweist und gute Renditen bietet. Das Unternehmen konzentriert sich zudem auf Bereiche wie Spezialpharmazeutika, Auftragsfertigung und Biosimilars. Travis Perkins, ein Baumarkthändler, verfügt über eine solide Bilanz und keine Finanzverbindlichkeiten. Die Dividendenrendite ist attraktiv und wird durch eine komfortable Ertragsdeckung abgedeckt. Wir verkauften JD Wetherspoon aufgrund von Bedenken hinsichtlich der Bilanz des Unternehmens und der Unabhängigkeit von Verwaltungsratsmitgliedern. Außerdem verkauften wir United Utilities, um eine neue Position in SSE zu finanzieren, einem führenden Entwickler und Betreiber von erneuerbaren Energien und kohlenstoffarmer Infrastruktur.

Zu den neuen Positionen in Threadneedle (Lux) - American Fund und Threadneedle (Lux) - American Select Fund gehörten Intuitive Surgical und Procter & Gamble. Intuitive Surgical stellt Roboterausstattung für die minimalinvasive Chirurgie her und bietet aufgrund des riesigen potenziellen Zielmarkts des Unternehmens im Bereich der Weichteilchirurgie eine attraktivere Gelegenheit im Vergleich zu seinen großen Wettbewerbern in der Kategorie Medizinprodukte. Procter & Gamble bietet auf kürzere Sicht ein defensives Ertragsprofil und war in der Vergangenheit ein hervorragender Ertragsbringer. Das sich verbessernde Wachstumsprofil des Unternehmens führt zu einem verbesserten operationalen Leverage, welches das Gewinnwachstum sowie das Potenzial für Aktionärsrenditen begünstigen sollte, wenn vorübergehende Kosten und der Gegenwind durch die Wechselkursentwicklung nachlassen. Verkäufe umfassten CVS Health, Cisco Systems und Mirati Therapeutics.

Neue Positionen im Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies Fund umfassten Applied Industrial Technologies, Cable One und Stanley Black & Decker. Applied Industrial Technologies ist ein industrieller Distributor, der sich auf Antrieb und Automatisierung konzentriert. Das Unternehmen hat aufgrund seiner anhaltenden Marktanteilsgewinne, seiner operativen Effizienz und des Trends zur Neuausrichtung der Fertigung eine bedeutende Chance, seine Umsätze, Margen und seinen freien Cashflow zu steigern. Cable One unterscheidet sich von seinen Mitbewerbern großer Aktienunternehmen, indem es sich hauptsächlich auf die Bereitstellung von Breitbandverbindungen in ländlichen Gebieten konzentriert und weniger auf Video-/Kabelfernsehen. Das Unternehmen ist auch für seine verantwortungsvolle Investitionstätigkeit bekannt. Stanley Black & Decker hat in den letzten Jahren hart daran gearbeitet, sein Portfolio zu reduzieren, um sich auf Elektrowerkzeuge und Befestigungselemente sowie Marken zu konzentrieren, die bekannt sind und gute Händlerunterstützung bieten. Das Unternehmen verfügt außerdem über überzeugende Referenzen im Bereich verantwortungsbewusste Anlagen, darunter insbesondere einer klar definierten Strategie und Offenlegungen. Die Verkäufe umfassten Lamb Weston, Natus Medical und EVO Payments.

Mit Blick auf die Zukunft scheint die Inflation in den USA bereits ihren Höhepunkt überschritten zu haben. Die jüngsten Marktpreise aufgrund von Zinssenkungen in den USA im weiteren Jahresverlauf erscheinen gerechtfertigt, und wir glauben, dass Spielraum für weitere Zinssenkungen besteht. Risiken für diese Einschätzung sind unter anderem der weiterhin angespannte US-Arbeitsmarkt. Wenn sich der Lohnanstieg nicht wesentlich verlangsamt, könnte die Fed die Zinsen weiter erhöhen. In Europa und dem Vereinigten Königreich stärken indessen niedrigere Energiepreise das Verbrauchervertrauen, was wiederum das Vertrauen der Unternehmen stärken sollte. Die im Zuge der Pandemie erzielten Einsparungen wurden nicht in demselben Ausmaß wie in den USA reduziert, was die relative Stärke der britischen und europäischen Verbraucher weiter verbesserte. Wenn die Inflation weiter nachlässt und der Fokus auf Zinserhöhungen abnimmt, sollte sich der wirtschaftliche Ausblick für beide Regionen im Laufe des Jahres 2023 weiter verbessern.

Weltweit stellte die Null-Covid-Politik in China im Jahr 2022 einen anhaltenden Gegenwind dar. Nun, da sie aufgegeben wurde, sollten die Probleme in der Lieferkette, die weltweit eine wichtige Quelle für Inflation und Margenverringerung waren, weiter nachlassen. Die Lockerung der Restriktionen sollte auch den globalen Unternehmensgewinnen Auftrieb verleihen. Bestimmte Unternehmen in Asien und Europa dürften angesichts der erheblichen Nachfrage Chinas nach Halbleitern und Luxusgütern am meisten profitieren.

Ein stetiger Strom von besseren Wirtschaftsdaten deutet zunehmend auf eine „weiche Landung“ in den USA, der Eurozone und im Vereinigten Königreich hin, was für einen milderen Ertragsrückgang spricht, als zuvor befürchtet. Rezessionen in großen Volkswirtschaften sind in diesem Jahr weiterhin möglich, wobei Abwärtsrisiken auf die Gefahr zurückzuführen sind, dass die Zentralbanken aufgrund der Lohninflation weiterhin einen allzu harten Kurs fahren. Zu den Aufwärtsrisiken gehört die Möglichkeit, dass die vorherige geldpolitische Straffung und die niedrigeren Energiepreise eine stärkere Wirkung auf die Senkung der Inflation und das Verbrauchervertrauen haben, als derzeit angenommen wird.

Insgesamt halten wir ausgewählte Risikoanlagen weiterhin für wertvoll, insbesondere die Aktien und Anleihen von Unternehmen mit relativ defensiven Cashflows.

Der Verwaltungsrat

20. Juni 2023

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist keine Garantie für die künftige Entwicklung. Der Wert von Anlagen und über diese erzielten Erträge kann sowohl ab- als auch zunehmen.

Wertentwicklung

Threadneedle (Lux) Portfolio-Rendite für das Berichtsjahr zum 31. März 2023:

Portfolio	Einjährige Rendite*	
	Hauptanteilkasse	
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	ZU	-5,74 %
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	ZE	-8,14 %
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	ZE	-5,56 %
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	ZE	-0,21 %
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	ZE	-8,95 %
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	AE	-7,58 %
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	AU	-3,29 %
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	ZU	-5,90 %
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	AU	-2,67 %
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	ZU	-2,81 %
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	ZU	-4,76 %
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	AE	-6,30 %
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	AU	-7,20 %
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	ZU	-4,27 %
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	ZE	-13,54 %
Threadneedle (Lux) - Global Focus	ZU	-8,44 %
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	ZU	-14,13 %
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	ZU	-3,61 %
Threadneedle (Lux) - Global Select	ZU	-11,01 %
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	ZE	-6,61 %
Threadneedle (Lux) - American	ZU	-9,38 %
Threadneedle (Lux) - American Select	ZU	-11,98 %
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	ZU	-8,02 %
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	ZU	-11,33 %
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	ZU	-14,36 %
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	ZU	-9,62 %
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	ZU	-7,20 %
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	AE	0,00 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	ZE	3,57 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	ZE	-12,46 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	ZE	-10,49 %
Threadneedle (Lux) - European Select	AE	2,27 %
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	ZE	-5,25 %
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	ZUP	-10,29 %
Threadneedle (Lux) - Global Technology	ZU	-10,94 %
Threadneedle (Lux) - UK Equities	ZG	6,01 %
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	ZG	4,10 %
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity**	ZU	-5,05 %
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	ZU	-1,58 %
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	ZE	-4,52 %
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	ZE	-5,23 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	ZE	2,20 %
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	ZU	-14,12 %
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	ZU	-11,74 %
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	ZU	-10,07 %

Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

*Die Wertentwicklung ist für ein Jahr oder – für während des Geschäftsjahres aufgelegte Anteilklassen – seit dem Auflegungsdatum angegeben.

**Siehe Erläuterung 1.



Bericht des Abschlussprüfers

An die Anteilhaber von
Threadneedle (Lux)

Unser Testat

Nach unserer Auffassung vermittelt der beigefügte Abschluss ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage von Threadneedle (Lux) (der „Fonds“) und seiner einzelnen Teilfonds zum 31. März 2023 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Nettovermögens für das entsprechende Jahr in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Erstellung und Darstellung des Abschlusses.

Was wir geprüft haben

Der Abschluss des Fonds umfasst:

- die konsolidierte Aufstellung des Nettovermögens für den Fonds und die Aufstellung des Nettovermögens für jeden der Teilfonds zum 31. März 2023;
- die konsolidierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und die Entwicklung des Nettovermögens für den Fonds sowie die Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens für jeden der Teilfonds für das entsprechende Jahr;
- die Portfolioaufstellung zum 31. März 2023; und
- die Erläuterungen zum Abschluss, die eine Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsgrundsätze enthalten.

Grundlage für unser Testat

Wir haben unsere Prüfung unter Beachtung des Gesetzes vom 23. Juli 2016 über die Prüfungstätigkeit (Gesetz vom 23. Juli 2016) und der von der Finanzaufsichtsbehörde „Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF)“ für Luxemburg umgesetzten internationalen Abschlussprüfungsstandards (ISAs) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten im Rahmen des Gesetzes vom 23. Juli 2016 und der von der CSSF für Luxemburg umgesetzten ISAs sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten der Abschlussprüfer für die Prüfung des Abschlusses“ in unserem Bericht näher beschrieben.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise eine ausreichende und geeignete Grundlage für unser Testat darstellen.

Wir sind gemäß dem International Code of Ethics for Professional Accountants (including International Independence Standards) des International Ethics Standards Board for Accountants (IESBA Code) in der für Luxemburg von der CSSF umgesetzten Fassung sowie den für unsere Abschlussprüfung maßgeblichen ethischen Anforderungen von dem Fonds unabhängig. Wir haben unsere sonstigen ethischen Verpflichtungen gemäß diesen Anforderungen erfüllt.

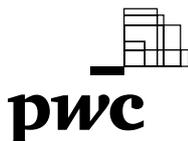
Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Zu den sonstigen Informationen gehören die im Jahresbericht aufgeführten Informationen, jedoch nicht der Abschluss und unser diesbezüglicher Bericht des Abschlussprüfers.

Unsere Stellungnahme zum Abschluss deckt nicht die sonstigen Informationen ab und wir geben diesbezüglich keine versichernde Schlussfolgerung ab.

*PricewaterhouseCoopers, Société coopérative, 2 rue Gerhard Mercator, B.P. 1443, L-1014 Luxembourg
T: +352 494848 1, F: +352 494848 2900, www.pwc.lu*

*Cabinet de révision agréé. Expert-comptable (autorisation gouvernementale n°10028256)
R.C.S. Luxembourg B 65 477 - TVA LU25482518*



In Verbindung mit unserer Prüfung des Abschlusses besteht unsere Verantwortung darin, die sonstigen oben angegebenen Informationen zu lesen und dabei zu prüfen, ob die sonstigen Informationen in wesentlichem Maße dem Abschluss oder unserem bei der Prüfung erlangten Wissen widersprechen oder anderweitig in wesentlichem Maße falsch dargestellt sind. Wenn wir aufgrund unserer durchgeführten Arbeit zu dem Schluss kommen, dass es eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen gibt, sind wir verpflichtet, dies zu melden. Wir haben in dieser Hinsicht jedoch nichts zu vermelden.

Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats für den Jahresabschluss

Der Verwaltungsrat ist verantwortlich für die Erstellung und angemessene Darstellung des Abschlusses in Übereinstimmung mit den gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Erfordernissen des Großherzogtums Luxemburg bezüglich der Erstellung und Präsentation von Abschlüssen sowie für die interne Kontrolle, die der Verwaltungsrat für notwendig erachtet, um die Erstellung eines Abschlusses zu gewährleisten, der keine wesentlichen Fehlaussagen, sei es aufgrund von Betrug oder Irrtum, enthält.

Bei der Erstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat für die Beurteilung der Fortführungsfähigkeit des Fonds und seiner einzelnen Teilfonds verantwortlich, legt Angelegenheiten im Zusammenhang mit der Unternehmensfortführung offen und wendet den Grundsatz der Unternehmensfortführung an, es sei denn, der Verwaltungsrat beabsichtigt, den Fonds zu liquidieren, einen seiner Teilfonds zu schließen oder die Geschäftstätigkeit einzustellen, oder er hat hierzu keine realistische Alternative.

Verantwortlichkeiten der Abschlussprüfer für die Prüfung des Abschlusses

Ziel unserer Prüfung ist es, ausreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen ist, ganz gleich, ob diese aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern entstanden sind, und einen Bericht zu erstellen, der unser Testat enthält. Dies ist aber keine Garantie dafür, dass eine Prüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den von der CSSF für Luxemburg umgesetzten ISAs grundsätzlich bestehende wesentliche falsche Darstellungen aufdecken wird. Falsche Darstellungen können sich aus dolosen Handlungen oder Irrtümern ergeben und gelten als wesentlich, wenn vernünftigerweise zu erwarten ist, dass sie einzeln oder in ihrer Gesamtheit die wirtschaftlichen Entscheidungen von Anlegern, die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffen werden, beeinflussen könnten.

Im Rahmen unserer Abschlussprüfung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den von der CSSF für Luxemburg umgesetzten ISAs üben wir während der Prüfung pflichtgemäßes Ermessen aus und gehen mit professioneller Skepsis vor. Zu unseren weiteren Aufgaben gehören:

- die Identifizierung und Bewertung der Risiken wesentlicher falscher Angaben im Abschluss, sei es aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, die Planung und Durchführung von Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken und die Erlangung von Prüfungsnachweisen, die eine ausreichende und geeignete Grundlage für unser Testat darstellen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen nicht entdeckt werden, ist höher als bei wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von Irrtümern, da dolose Handlungen Absprachen, Fälschungen, absichtliche Auslassungen, falsche Darstellungen oder die Umgehung der internen Kontrolle beinhalten können;
- die Erlangung eines Verständnisses der für die Prüfung relevanten internen Kontrollstrukturen, um die unter diesen Umständen angemessenen Prüfungshandlungen festzulegen, nicht jedoch, um ein Testat über die Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben;
- die Bewertung der Eignung der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze und der Angemessenheit der vom Verwaltungsrat vorgenommenen Schätzungen und damit verbundenen Angaben;



- eine Schlussfolgerung darüber abzugeben, ob der vom Verwaltungsrat angewandte Grundsatz der Unternehmensfortführung angemessen ist, und ob auf der Grundlage der gewonnenen Prüfungsnachweise eine wesentliche Unsicherheit in Bezug auf Ereignisse oder Umstände besteht, die erhebliche Zweifel an der Fortführungsfähigkeit des Fonds oder eines seiner Teilfonds begründen können. Wenn wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, in unserem Prüfungsbericht auf die entsprechenden Angaben im Abschluss hinzuweisen, oder, falls diese Angaben nicht ausreichend sind, unser Testat zu ändern. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den Prüfungsnachweisen, die wir bis zum Datum unseres Prüfungsberichts erhalten haben. Zukünftige Ereignisse oder Bedingungen können jedoch dazu führen, dass der Fonds oder einer seiner Teilfonds (mit Ausnahme des Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return Portfolio, des Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities Portfolio und des Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolio, deren Auflösung beschlossen wurde) nicht mehr fortgeführt werden kann;
- die Beurteilung der Gesamtdarstellung, der Struktur und des Inhalts des Abschlusses, einschließlich der Abschlussangaben, und der Frage, ob der Abschluss die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild entsteht.

Wir kommunizieren mit den für die Überwachung Verantwortlichen unter anderem über den geplanten Umfang und Zeitpunkt der Prüfung und wesentliche Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger wesentlicher Mängel im internen Kontrollsystem, die wir im Rahmen unserer Prüfung feststellen.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Vertreten durch

Luxemburg, 21. Juni 2023

Serene Shtayyeh

Konsolidierter Abschluss für Threadneedle (Lux)

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2, 18	16.556.964.184
Bankguthaben	2	179.121.736
Termineinlagen	2, 19	14.974.756
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		55.870.265
Forderungen aus Zeichnungen		15.613.347
Zinsforderungen aus Swaps	2	7.298.009
Dividendenforderungen aus Swaps	2	206.059
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		46.016.138
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	15.232.547
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2, 10	3.092.456
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	2, 11	410.364
Sonstige Aktiva	20	18.554.447
Aktiva, insgesamt		16.913.354.308
Passiva		
Überziehungskredite		(45)
Zum Marktwert verkaufte Optionen	2, 12	(377.061)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(61.428.459)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(20.430.368)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(2.695.192)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(391.625)
Eingegangene Vorauszahlung aus Swaps	2	(57.508)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(1.868.149)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(8.496.516)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten	2, 11	(10.099.036)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(14.232.573)
Steuerverbindlichkeit	3	(25.824)
Sonstige Passiva		(2.504.147)
Passiva, insgesamt		(122.606.503)
Nettovermögen, insgesamt		16.790.747.805

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		20.624.583.517
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	202.616.366
Zinsen aus Anleihen, netto	2	104.565.914
Zinsen aus Bankguthaben	2	3.691.072
Dividendenerträge aus Swaps		700
Zinsen aus Swaps		11.160.168
Zinsen aus Terminkontrakten		745.046
Sonstige Erträge		1.446.413
Erträge, insgesamt		324.225.679
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(170.403.469)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(744.885)
Dividendenaufwand aus Swaps		(2.065.012)
Zinsaufwand aus Swaps		(28.319.317)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(707.995)
Betriebskosten	3, 5	(31.043.025)
Sonstige Gebühren	4	(1.752)
Aufwand, insgesamt		(233.285.455)
Nettoertrag aus Anlagen		90.940.224
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(456.297.502)
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(20.930.559)
Realisierter Nettogewinn aus Optionen		365.179
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(49.452.671)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		93.828.629
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(9.977.161)
Realisierter Netto(verlust) aus Steuerrückforderungen		(68)
Realisierter Netto(verlust)		(442.464.153)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(1.129.292.925)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		1.286.803
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Optionen		24.932
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(9.946.578)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Terminkontrakten		(35.560.181)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(1.173.487.949)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit (1.525.011.878)		
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		4.757.553.155
Anteilrücknahmen		(6.729.787.549)
Dividenden	7	(51.678.952)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(2.023.913.346)
Wechselkursdifferenzen	2	(307.250.585)
Änderung der Überkreuzbeteiligungen in Portfolios	18	22.340.097
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		16.790.747.805

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	795.139.447
Bankguthaben	2	17.657.236
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		28.189.947
Forderungen aus Zeichnungen		1.422.255
Zinsforderungen aus Swaps	2	108.086
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		7.131.944
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	4.390.217
Aktiva, insgesamt		854.039.132
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(17.649.418)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(1.139.392)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(125.440)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(39.609)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten	2, 11	(709.109)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(180.908)
Sonstige Passiva		(69.951)
Passiva, insgesamt		(19.913.827)
Nettovermögen, insgesamt		834.125.305

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEC	1.582.554,099
Klasse AEH	1.232.059,977
Klasse AKH	70,000
Klasse ANH	788,000
Klasse AU	850.426,238
Klasse AUP	119.079,612
Klasse DEC	84.212,698
Klasse DEH	221.583,196
Klasse DU	195.901,800
Klasse DUP	54.784,490
Klasse IEC	9.947.624,918
Klasse IEH	1.820.155,984
Klasse IEP	74,000
Klasse IGC	616,000
Klasse IGH	1.390.517,542
Klasse IKH	80.378,000
Klasse INH	785,000
Klasse IU	137.275,508
Klasse IUP	278.252,656
Klasse NEC	458.377,092
Klasse NEH	115.600,495
Klasse NGC	37.860.342,347
Klasse NGH	2.569.628,591
Klasse NU	1.760.849,599
Klasse NUP	115.563,000
Klasse XEH	84,000
Klasse XFH	92,000
Klasse XGH	9.880.474,395
Klasse XU	100,000
Klasse ZEH	4.267.530,750
Klasse ZFH	93,000
Klasse ZGH	47.023,907
Klasse ZU	619.444,588

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		512.857.786
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	412.859
Zinsen aus Anleihen, netto	2	17.816.180
Zinsen aus Bankguthaben	2	453.223
Zinsen aus Swaps		2.439.164
Sonstige Erträge		15
Erträge, insgesamt		21.121.441
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.711.049)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(95.962)
Zinsaufwand aus Swaps		(2.677.206)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(230.322)
Betriebskosten	3, 5	(746.019)
Sonstige Gebühren	4	(103)
Aufwand, insgesamt		(5.460.661)
Nettoertrag aus Anlagen		15.660.780
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(46.351.334)
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(154.422)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(4.550.629)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		7.938.224
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(6.318.855)
Realisierter Netto(verlust)		(49.437.016)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(9.766.807)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		1.447.518
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(2.781.504)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Terminkontrakten		(2.383.300)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(13.484.093)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(47.260.329)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		519.839.894
Anteilrücknahmen		(139.300.262)
Dividenden	7	(12.011.784)
Kapitalbewegungen, insgesamt		368.527.848
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		834.125.305

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	834.125.305	512.857.786	505.611.566

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AEC	8,7274 ¹	9,8883 ¹	10,7710 ¹
Klasse AEH	10,3414 ¹	11,3032 ¹	12,0116 ¹
Klasse AKH	104,4023 ²	113,5556 ²	120,4075 ²
Klasse ANH	9,3808 ³	10,1321 ³	10,6766 ³
Klasse AU	12,0789	12,8471	13,5238
Klasse AUP	10,2933	11,3413	12,2255
Klasse DEC	7,8703 ¹	8,9807 ¹	9,8546 ¹
Klasse DEH	9,7853 ¹	10,7729 ¹	11,5352 ¹
Klasse DU	10,4059	11,1512	11,8269
Klasse DUP	9,0388	10,0429	10,9155
Klasse IEC	8,6087 ¹	9,7281 ¹	10,5732 ¹
Klasse IEH	10,6546 ¹	11,6146 ¹	12,3172 ¹
Klasse IEP	10,3441 ¹	11,0997 ¹	11,3003 ¹
Klasse IGC	8,9969 ⁴	10,0201 ⁴	10,8060 ⁴
Klasse IGH	11,5557 ⁴	12,4075 ⁴	13,0594 ⁴
Klasse IKH	107,4977 ²	116,6619 ²	123,3018 ²
Klasse INH	9,4739 ³	10,2127 ³	10,7232 ³
Klasse IU	12,4379	13,1938	13,8609
Klasse IUP	9,5805	10,5391	11,3406
Klasse NEC	8,6991 ¹	9,8160 ¹	10,6452 ¹
Klasse NEH	9,7048 ¹	10,5687 ¹	11,1857 ¹
Klasse NGC	8,8347 ⁴	9,8219 ⁴	10,5683 ⁴
Klasse NGH	10,2097 ⁴	10,9467 ⁴	11,4987 ⁴
Klasse NU	10,8438	11,4874	12,0441
Klasse NUP	9,6764	10,6244	11,4076
Klasse XEH	8,5918 ¹	9,3311 ¹	9,8476 ¹
Klasse XFH	8,4935 ⁵	9,2943 ⁵	9,8342 ⁵
Klasse XGH	10,1116 ⁴	10,8105 ⁴	11,3216 ⁴
Klasse XU	8,9631	9,4664	9,8938
Klasse ZEH	9,7722 ¹	10,6577 ¹	11,2951 ¹
Klasse ZFH	8,3827 ⁵	9,2148 ⁵	9,8121 ⁵
Klasse ZGH	11,5218 ⁴	12,3692 ⁴	13,0122 ⁴
Klasse ZU	12,4147	13,1713	13,8304

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

²Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

³Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

⁴Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

⁵Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	78.612.807
Bankguthaben	2	1.170.316
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		308.798
Forderungen aus Zeichnungen		8.597
Zinsforderungen aus Swaps	2	11.207
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		751.199
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	82.484
Sonstige Aktiva		14.479
Aktiva, insgesamt		80.959.887
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(584.734)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(1)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(18.084)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(90.403)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten	2, 11	(105.274)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(21.310)
Sonstige Passiva		(6.678)
Passiva, insgesamt		(826.484)
Nettovermögen, insgesamt		80.133.403

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	97.083,650
Klasse ANH	825,000
Klasse IE	1.129.373,041
Klasse IEP	535.456,801
Klasse INH	817,000
Klasse XE	84,000
Klasse XFH	92,000
Klasse XGH	72,000
Klasse XUH	100,000
Klasse ZE	10.456,091
Klasse ZFH	92,000
Klasse 1E	6.012.518,163
Klasse 1G	132.220,412
Klasse 2E	2.138.298,351
Klasse 2G	69,000
Klasse 3G	478.605,918
Klasse 4E	3.444,353
Klasse 4G	3.089.310,148
Klasse 8E	361.321,298
Klasse 8G	139.623,318
Klasse 9G	70,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		127.675.204
Ertrag		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	1.733.528
Zinsen aus Bankguthaben	2	5.206
Zinsen aus Swaps		122.573
Zinsen aus Terminkontrakten		9.203
Sonstige Erträge		13
Erträge, insgesamt		1.870.523
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(296.214)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(9.074)
Zinsaufwand aus Swaps		(325.287)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(5.189)
Betriebskosten	3, 5	(102.792)
Aufwand, insgesamt		(738.556)
Nettoertrag aus Anlagen		1.131.967
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(9.759.473)
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(128.819)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(824.394)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		2.003.336
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		161.503
Realisierter Netto(verlust)		(8.547.847)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(1.730.303)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		264.444
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		162.407
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Terminkontrakten		(879.367)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(2.182.819)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(9.598.699)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		15.241.844
Anteilrücknahmen		(53.159.234)
Dividenden	7	(25.712)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(37.943.102)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		80.133.403

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
EUR	80.133.403	127.675.204	157.999.564

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	9,2779	10,1243	10,7975
Klasse ANH	9,1104 ¹	9,8409 ¹	10,4217 ¹
Klasse IE	9,5112	10,3374	10,9588
Klasse IEP	8,3544	9,2711	–
Klasse INH	9,2841 ¹	9,9943 ¹	10,5063 ¹
Klasse XE	8,8344	9,5748	10,1073
Klasse XFH	8,7183 ²	9,5292 ²	10,0938 ²
Klasse XGH	9,0433 ³	9,6585 ³	10,1315 ³
Klasse XUH	9,1567 ⁴	9,6777 ⁴	10,1441 ⁴
Klasse ZE	9,4441	10,2805	10,9309
Klasse ZFH	8,5999 ²	9,4512 ²	10,0801 ²
Klasse 1E	1,2624	1,3811	1,4728
Klasse 1G	1,0210 ³	1,0743 ³	1,1548 ³
Klasse 2E	9,5174	10,3490	10,9688
Klasse 2G	9,2882 ³	9,7243 ³	10,3939 ³
Klasse 3G	1,1557 ³	1,2099 ³	1,2941 ³
Klasse 4E	9,6587	10,4502	11,0208
Klasse 4G	9,7717 ³	10,1679 ³	10,8094 ³
Klasse 8E	1,5938	1,7338	1,8383
Klasse 8G	1,4020 ³	1,4667 ³	1,5677 ³
Klasse 9G	9,2626 ³	9,7021 ³	10,3783 ³

¹Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

²Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

³Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

⁴Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	394.430.856
Bankguthaben	2	5.261.324
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.198.431
Forderungen aus Zeichnungen		73.785
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		5.669.608
Aktiva, insgesamt		406.634.004
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(2.538.738)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(435.842)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(481.773)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten	2, 11	(80.768)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(279.988)
Sonstige Passiva		(48.234)
Passiva, insgesamt		(3.865.343)
Nettovermögen, insgesamt		402.768.661

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	342,253
Klasse AKH	81,000
Klasse ANH	807,000
Klasse IE	5.849.877,990
Klasse IEP	6.024.823,785
Klasse IKH	80,000
Klasse INH	798,000
Klasse XE	77,000
Klasse ZE	39.985,677
Klasse ZEP	120.094,000
Klasse 1E	12.090.868,369
Klasse 1EP	1.046.935,471
Klasse 1G	234.473,801
Klasse 1GP	3.374,897
Klasse 1UT	119.164,536
Klasse 2E	30.299,719
Klasse 2EP	2.884,000
Klasse 2FH	6.834,346
Klasse 2G	68,000
Klasse 2GP	75,000
Klasse 3E	2.912.931,952
Klasse 3EP	1.845.688,854
Klasse 3FC	6.523,913
Klasse 3FH	27.927,294
Klasse 3G	737.641,440
Klasse 3GP	58.701,986
Klasse 4E	299,277
Klasse 4G	65,000
Klasse 8E	1.894.692,429
Klasse 8EP	5.555.524,634
Klasse 8FH	32.415,940
Klasse 8G	9.193,774
Klasse 8GP	5.021,867
Klasse 9E	3.471.833,446
Klasse 9EP	7.573,873
Klasse 9FC	92,741
Klasse 9FH	83,000
Klasse 9G	67,000
Klasse 9GP	75,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		437.563.292
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	43.405
Zinsen aus Anleihen, netto	2	15.324.515
Zinsen aus Bankguthaben	2	18.018
Zinsen aus Terminkontrakten		6.765
Sonstige Erträge		584
Erträge, insgesamt		15.393.287
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(3.164.958)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(14.800)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(3.292)
Betriebskosten	3, 5	(573.329)
Aufwand, insgesamt		(3.756.379)
Nettoertrag aus Anlagen		11.636.908
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(17.251.364)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		2.810.337
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		388.516
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(492.964)
Realisierter Netto(verlust)		(14.545.475)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(20.642.556)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(1.702.941)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Terminkontrakten		(174.313)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(22.519.810)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(25.428.377)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		97.023.824
Anteilrücknahmen		(101.198.233)
Dividenden	7	(5.191.845)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(9.366.254)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		402.768.661

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
EUR	402.768.661	437.563.292	601.800.632

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	10,1138	10,7825	11,2181
Klasse AKH	95,0769 ¹	101,0117 ¹	104,9357 ¹
Klasse ANH	9,6834 ²	10,2186 ²	10,5488 ²
Klasse IE	10,2265	10,8198	11,1683
Klasse IEP	8,4447	9,3088	9,9899
Klasse IKH	97,5060 ¹	102,8317 ¹	105,8588 ¹
Klasse INH	9,9336 ²	10,4003 ²	10,6479 ²
Klasse XE	10,0295	10,5517	10,8140
Klasse ZE	10,1957	10,7962	11,1495
Klasse ZEP	8,4197	9,2891	9,9735
Klasse 1E	9,9677	10,6162	11,0164
Klasse 1EP	8,2294	9,1329	9,8573
Klasse 1G	9,7341 ³	9,9707 ³	10,4297 ³
Klasse 1GP	8,0597 ³	8,6028 ³	9,3569 ³
Klasse 1UT	9,0587 ⁴	9,8080 ⁴	10,4752 ⁴
Klasse 2E	10,2262	10,8306	11,1761
Klasse 2EP	8,4747	9,3488	10,0267
Klasse 2FH	10,0034 ⁵	10,6851 ⁵	11,0615 ⁵
Klasse 2G	9,9771 ³	10,1723 ³	10,5872 ³
Klasse 2GP	8,2855 ³	8,7869 ³	9,4995 ³
Klasse 3E	10,2522	10,8528	11,1933
Klasse 3EP	8,5292	9,4075	10,0878
Klasse 3FC	8,3106 ⁵	9,2459 ⁵	9,9302 ⁵
Klasse 3FH	10,0264 ⁵	10,7045 ⁵	11,0760 ⁵
Klasse 3G	10,0112 ³	10,1921 ³	10,5964 ³
Klasse 3GP	8,2268 ³	8,7267 ³	9,4331 ³
Klasse 4E	10,5853	11,1273	11,3964
Klasse 4G	10,5718 ³	10,6900 ³	11,0365 ³
Klasse 8E	10,2071	10,8147	11,1642
Klasse 8EP	8,4670	9,3469	10,0322
Klasse 8FH	9,9839 ⁵	10,6685 ⁵	11,0486 ⁵
Klasse 8G	9,9700 ³	10,1593 ³	10,5718 ³
Klasse 8GP	8,2518 ³	8,7611 ³	9,4964 ³
Klasse 9E	10,2702	10,8653	11,2018
Klasse 9EP	8,5477	9,4214	10,0992
Klasse 9FC	8,4020 ⁵	9,3284 ⁵	10,0032 ⁵
Klasse 9FH	10,0637 ⁵	10,7239 ⁵	11,0918 ⁵
Klasse 9G	10,0498 ³	10,2232 ³	10,6161 ³
Klasse 9GP	8,3237 ³	8,8161 ³	9,5122 ³

¹Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

²Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

³Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

⁴Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

⁵Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	66.936.251
Bankguthaben	2	2.416.289
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		5.388
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		810.769
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	34.475
Sonstige Aktiva		3
Aktiva, insgesamt		70.203.175
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(178.128)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(14.019)
Sonstige Passiva		(6.159)
Passiva, insgesamt		(198.306)
Nettovermögen, insgesamt		70.004.869

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	1.739,363
Klasse AEP	312,510
Klasse AKH	82,000
Klasse ANH	82,000
Klasse IE	316.313,308
Klasse IEP	93.668,000
Klasse IGC	8,000
Klasse IGH	7,000
Klasse IKH	82,000
Klasse INH	816,000
Klasse XE	378,910
Klasse XGC	50.662,801
Klasse XGH	187.795,591
Klasse ZE	8,200

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	101,8726	102,3925	103,3869
Klasse AEP	88,7739	92,7591	97,3234
Klasse AKH	102,7200 ¹	102,9071 ¹	103,6634 ¹
Klasse ANH	105,2758 ²	104,6701 ²	104,8255 ²
Klasse IE	103,3939	103,5067	104,0942
Klasse IEP	90,1405	93,8051	97,9620
Klasse IGC	93,3526 ³	95,6430 ³	99,1215 ³
Klasse IGH	106,5129 ³	105,1039 ³	105,0674 ³
Klasse IKH	103,6474 ¹	103,4243 ¹	103,8150 ¹
Klasse INH	10,5733 ²	10,4750 ²	10,4542 ²
Klasse XE	104,9403	104,6355	104,8093
Klasse XGC	94,5441 ³	96,4461 ³	99,6631 ³
Klasse XGH	108,3422 ³	106,2932 ³	105,8053 ³
Klasse ZE	103,1073	103,3293	104,0037

¹Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.²Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.³Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		108.281.110
Ertrag		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	3.319.131
Zinsen aus Bankguthaben	2	9.946
Zinsen aus Swaps		13.875
Sonstige Erträge		266
Erträge, insgesamt		3.343.218
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(106.261)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(11.283)
Betriebskosten	3, 5	(86.350)
Aufwand, insgesamt		(203.894)
Nettoertrag aus Anlagen		3.139.324
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(2.832.371)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(524.687)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(326.302)
Realisierter Netto(verlust)		(3.683.360)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(1.908.158)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(10.110)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(433.051)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(2.351.319)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(2.895.355)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		36.495.370
Anteilrücknahmen		(71.328.517)
Dividenden	7	(547.739)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(35.380.886)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		70.004.869

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
EUR	70.004.869	108.281.110	87.774.729

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	348.288.199
Bankguthaben	2	4.825.278
Forderungen aus Zeichnungen		98.135
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		2.567.109
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	358.560
Aktiva, insgesamt		356.137.281
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(584.563)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten	2, 9	(700.622)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(92.597)
Sonstige Passiva		(35.887)
Passiva, insgesamt		(1.413.669)
Nettovermögen, insgesamt		354.723.612

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	1.662.303,414
Klasse AEP	45.336,000
Klasse AFH	93,000
Klasse AKH	86,000
Klasse ANH	861,000
Klasse ASC	100,000
Klasse ASH	100,000
Klasse AUC	100,000
Klasse AUH	100,000
Klasse ID	22.738.015,068
Klasse IE	3.798.586,372
Klasse IEP	2.541.188,149
Klasse IFH	2.709.537,000
Klasse IGH	73,000
Klasse IKH	85,000
Klasse INH	839,000
Klasse ISC	100,000
Klasse ISH	100,000
Klasse IUC	83.135,804
Klasse IUH	100,000
Klasse LE	3.128.597,916
Klasse NEP	111.878,641
Klasse ZD	11.948.350,717
Klasse ZE	2.657.416,258
Klasse ZEP	581.208,140
Klasse ZFH	3.489,000
Klasse ZGC	5.535.129,078
Klasse ZGH	808.400,965
Klasse ZUH	1.592,141

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		397.016.310
Ertrag		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	5.157.630
Zinsen aus Bankguthaben	2	16.188
Zinsen aus Terminkontrakten		68.723
Sonstige Erträge		176
Erträge, insgesamt		5.242.717
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.120.123)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(15.165)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(42.821)
Betriebskosten	3, 5	(435.254)
Aufwand, insgesamt		(1.613.363)
Nettoertrag aus Anlagen		3.629.354
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(19.638.314)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(364.930)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		5.048.821
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(535.930)
Realisierter Netto(verlust)		(15.490.353)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(23.595.761)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(186.030)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Terminkontrakten		(1.330.494)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(25.112.285)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(36.973.284)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		90.566.773
Anteilrücknahmen		(93.488.882)
Dividenden	7	(2.397.305)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(5.319.414)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		354.723.612

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
EUR	354.723.612	397.016.310	329.896.379

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	8,4945	9,3388	9,9729
Klasse AEP	8,2347	9,1831	9,9137
Klasse AFH	8,4045 ¹	9,3172 ¹	9,9710 ¹
Klasse AKH	85,5720 ²	93,6342 ²	99,5278 ²
Klasse ANH	8,6990 ³	9,4392 ³	9,9762 ³
Klasse ASC	8,4958 ⁴	9,3030 ⁴	9,9703 ⁴
Klasse ASH	8,7327 ⁴	9,4156 ⁴	9,9784 ⁴
Klasse AUC	8,5577 ⁵	9,3072 ⁵	9,9704 ⁵
Klasse AUH	8,7920 ⁵	9,4257 ⁵	9,9792 ⁵
Klasse ID	8,6319 ⁶	9,4617 ⁵	10,0874 ⁶
Klasse IE	9,1890	10,0871	10,7559
Klasse IEP	8,5025	9,4700	10,2088
Klasse IFH	8,8540 ¹	9,8039 ¹	10,4909 ¹
Klasse IGH	8,7057 ⁷	9,4189 ⁷	9,9775 ⁷
Klasse IKH	86,7033 ²	94,8504 ²	100,7592 ²
Klasse INH	8,9315 ³	9,6877 ³	10,2330 ³
Klasse ISC	8,5268 ⁴	9,3048 ⁴	9,9703 ⁴
Klasse ISH	8,7507 ⁴	9,4173 ⁴	9,9784 ⁴
Klasse IUC	8,5688 ⁵	9,3112 ⁵	9,9711 ⁵
Klasse IUH	8,8069 ⁵	9,4334 ⁵	9,9799 ⁵
Klasse LE	9,2177	10,1185	10,7895
Klasse NEP	857,1354	954,3554	1028,6742
Klasse ZD	8,6148 ⁶	9,4477 ⁶	10,0776 ⁶
Klasse ZE	9,1569	10,0568	10,7290
Klasse ZEP	8,4565	9,4219	10,1616
Klasse ZFH	8,8373 ¹	9,7912 ¹	10,4827 ¹
Klasse ZGC	8,9178 ⁷	9,7886 ⁷	10,4934 ⁷
Klasse ZGH	9,2550 ⁷	10,0164 ⁷	10,6218 ⁷
Klasse ZUH	9,0273 ⁵	9,6718 ⁵	10,2472 ⁵

¹Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

²Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

³Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

⁴Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

⁵Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

⁶Die Klasse lautet auf DKK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

⁷Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	128.688.046
Bankguthaben	2	7.809.696
Forderungen aus Zeichnungen		133.695
Zinsforderungen aus Swaps	2	57.140
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.566.253
Aktiva, insgesamt		138.254.830
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(335.435)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(282.595)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(79.908)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(81.880)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(282.967)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten	2, 11	(1.030.826)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(108.736)
Sonstige Passiva		(20.508)
Passiva, insgesamt		(2.222.855)
Nettovermögen, insgesamt		136.031.975

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	1.904.852,642
Klasse AEP	762.311,440
Klasse AKH	81,000
Klasse ANH	802,000
Klasse AUH	1.916,000
Klasse DE	1.002.501,131
Klasse DEP	1.338.522,221
Klasse DUH	87,000
Klasse IE	1.212.557,303
Klasse INH	792,000
Klasse ZE	85,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	27,7961	30,0762	31,0867
Klasse AEP	12,9611	14,5050	15,3978
Klasse AKH	95,0129 ¹	102,4839 ¹	105,8567 ¹
Klasse ANH	9,7316 ²	10,4094 ²	10,6864 ²
Klasse AUH	10,7647 ³	11,3753 ³	11,6784 ³
Klasse DE	25,7676	28,0352	29,1371
Klasse DEP	9,6172	10,8231	11,5522
Klasse DUH	10,4683 ³	11,1164 ³	11,4774 ³
Klasse IE	28,4329	30,5812	31,4196
Klasse INH	9,9751 ²	10,6102 ²	10,8071 ²
Klasse ZE	8,9875	9,6862	–

¹Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.²Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.³Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		186.513.439
Ertrag		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	5.386.424
Zinsen aus Bankguthaben	2	44.306
Zinsen aus Swaps		720.066
Sonstige Erträge		23
Erträge, insgesamt		6.150.819
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.416.880)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(25.921)
Zinsaufwand aus Swaps		(1.880.145)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(37.280)
Betriebskosten	3, 5	(299.216)
Sonstige Gebühren	4	(11)
Aufwand, insgesamt		(3.659.453)
Nettoertrag aus Anlagen		2.491.366
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(10.906.882)
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(503.713)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(2.077.747)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		6.842.378
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(81.023)
Realisierter Netto(verlust)		(6.726.987)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(7.276.139)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		1.641.802
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		724.694
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Terminkontrakten		(4.556.742)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(9.466.385)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(13.702.006)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		43.810.406
Anteilrücknahmen		(79.772.815)
Dividenden	7	(817.049)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(36.779.458)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		136.031.975

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
EUR	136.031.975	186.513.439	234.144.701

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds**AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS**

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	35.435.377
Bankguthaben	2	2.309.582
Forderungen aus Zeichnungen		125.391
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		453.160
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	310.224
Aktiva, insgesamt		38.633.734
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(2.632)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(35.259)
Sonstige Passiva		(5.362)
Passiva, insgesamt		(43.253)
Nettovermögen, insgesamt		38.590.481

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEC	544.222,112
Klasse AEH	244.955,999
Klasse AKH	80,000
Klasse ANH	792,000
Klasse ASH	7.673,293
Klasse AU	100.013,506
Klasse AUP	706.620,595
Klasse DEC	40.726,837
Klasse DEH	137.896,034
Klasse DU	176.490,195
Klasse IEC	258.086,000
Klasse IEH	412.310,970
Klasse IU	2.093,260
Klasse W	6.537,236
Klasse WEH	7.298,489
Klasse XUP	85,000
Klasse ZU	100,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AEC	10,2032 ¹	11,3376 ¹	12,9505 ¹
Klasse AEH	19,3369 ¹	20,5319 ¹	22,5246 ¹
Klasse AKH	91,8018 ²	96,8799 ²	105,9916 ²
Klasse ANH	9,3874 ³	9,8352 ³	10,6943 ³
Klasse ASH	13,2054 ⁴	13,7388 ⁴	14,9331 ⁴
Klasse AU	21,1802	21,9017	23,7934
Klasse AUP	6,7900	7,3555	8,3207
Klasse DEC	7,3807 ¹	8,2123 ¹	9,3896 ¹
Klasse DEH	14,8160 ¹	15,7465 ¹	17,2924 ¹
Klasse DU	16,4720	17,0502	18,5415
Klasse IEC	7,8180 ¹	8,6232 ¹	9,7778 ¹
Klasse IEH	27,6949 ¹	29,1681 ¹	31,7423 ¹
Klasse IU	10,9376	11,2198	12,0940
Klasse W	29,1323	30,0194	32,4983
Klasse WEH	19,0279 ¹	20,1302 ¹	22,0058 ¹
Klasse XUP	9,7987	10,5075	11,7343
Klasse ZU	8,9259	9,1419	–

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁴Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.**ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS**

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		40.997.023
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	35.790
Zinsen aus Anleihen, netto	2	1.831.211
Zinsen aus Bankguthaben	2	56.108
Zinsen aus Terminkontrakten		994
Sonstige Erträge		7
Erträge, insgesamt		1.924.110
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(410.709)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(3.104)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(17)
Betriebskosten	3, 5	(73.379)
Sonstige Gebühren	4	(27)
Aufwand, insgesamt		(487.236)
Nettoertrag aus Anlagen		1.436.874
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(1.046.490)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(1.345.800)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		575.768
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		6.632
Realisierter Netto(verlust)		(1.809.890)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(1.896.734)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		4.692
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Terminkontrakten		(192.573)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(2.084.615)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(2.457.631)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		5.374.104
Anteilrücknahmen		(4.754.070)
Dividenden	7	(568.945)
Kapitalbewegungen, insgesamt		51.089
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		38.590.481

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	38.590.481	40.997.023	47.451.659

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	29.271.015
Bankguthaben	2	776.856
Forderungen aus Zeichnungen		909
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		377.006
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	14.559
Aktiva, insgesamt		30.440.345
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(1.615)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(34.991)
Sonstige Passiva		(5.174)
Passiva, insgesamt		(41.780)
Nettovermögen, insgesamt		30.398.565

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEC	46.569,415
Klasse AEH	13.233,968
Klasse AKH	82,000
Klasse ANH	818,000
Klasse ASH	272.273,409
Klasse AU	47.418,475
Klasse AUP	2.457.890,528
Klasse DEH	20.054,742
Klasse DU	18.318,766
Klasse IEH	17.657,346
Klasse IU	89,000
Klasse SU	447,319
Klasse SUP	41.856,044
Klasse W	4.779,568
Klasse XUP	89,000
Klasse ZU	76,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AEC	6,9476 ¹	8,0881 ¹	9,2177 ¹
Klasse AEH	22,3440 ¹	24,6916 ¹	26,8384 ¹
Klasse AKH	84,1314 ²	92,6360 ²	100,7566 ²
Klasse ANH	8,5857 ³	9,3882 ³	10,1328 ³
Klasse ASH	10,8469 ⁴	11,7200 ⁴	12,6134 ⁴
Klasse AU	68,7292	73,6637	79,1694
Klasse AUP	8,8962	10,0463	11,3182
Klasse DEH	16,5765 ¹	18,3325 ¹	19,9465 ¹
Klasse DU	48,7787	52,3331	56,3008
Klasse IEH	24,8419 ¹	27,2289 ¹	29,3633 ¹
Klasse IU	9,5573	10,1566	10,8581
Klasse SU	27,5181	29,5378	31,7934
Klasse SUP	8,5265	9,6466	10,8819
Klasse W	57,6066	61,5266	65,8940
Klasse XUP	8,8010	9,8204	10,9029
Klasse ZU	11,1655	11,8658	12,6758

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁴Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		35.175.906
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	38.265
Zinsen aus Anleihen, netto	2	1.589.216
Zinsen aus Bankguthaben	2	32.309
Zinsen aus Terminkontrakten		213
Sonstige Erträge		1
Erträge, insgesamt		1.660.004
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(410.301)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(419)
Betriebskosten	3, 5	(71.257)
Sonstige Gebühren	4	(27)
Aufwand, insgesamt		(482.004)
Nettoertrag aus Anlagen		1.178.000
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(1.620.695)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(43.230)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		169.316
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		26.489
Realisierter Netto(verlust)		(1.468.120)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(2.098.990)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(12.646)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Terminkontrakten		(40.788)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(2.152.424)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(2.442.544)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		4.681.813
Anteilrücknahmen		(5.771.939)
Dividenden	7	(1.244.671)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(2.334.797)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		30.398.565

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	30.398.565	35.175.906	45.515.822

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	57.453.232
Bankguthaben	2	1.445.478
Forderungen aus Zeichnungen		769
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		739.989
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	292.959
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	2, 11	43.953
Aktiva, insgesamt		59.976.380
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(2.561)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(39.272)
Sonstige Passiva		(7.684)
Passiva, insgesamt		(49.517)
Nettovermögen, insgesamt		59.926.863

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEC	2.674.098,608
Klasse AEH	216.289,827
Klasse AKH	85,000
Klasse ANH	835,000
Klasse ASC	38.489,588
Klasse ASH	14.267,454
Klasse AU	336.766,572
Klasse AUP	1.276.546,614
Klasse DEH	84.792,632
Klasse DU	120.201,933
Klasse IE	173.632,512
Klasse IEH	609.670,444
Klasse XU	1.601.873,807
Klasse XUP	184.900,129
Klasse ZEH	15.664,000
Klasse ZU	100,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AEC	4,1720 ¹	4,6270 ¹	5,3304 ¹
Klasse AEH	13,2333 ¹	13,9674 ¹	15,3274 ¹
Klasse AKH	87,0471 ²	91,6130 ²	100,3800 ²
Klasse ANH	8,9568 ³	9,3476 ³	10,1668 ³
Klasse ASC	5,8342 ⁴	6,3399 ⁴	7,2335 ⁴
Klasse ASH	10,1810 ⁴	10,5249 ⁴	11,4387 ⁴
Klasse AU	16,6480	17,1041	18,5735
Klasse AUP	4,5925	4,9572	5,6508
Klasse DEH	10,2791 ¹	10,8662 ¹	11,9416 ¹
Klasse DU	12,9190	13,2928	14,4565
Klasse IE	9,6716 ¹	9,6301 ¹	9,8260 ¹
Klasse IEH	15,3381 ¹	16,0698 ¹	17,5011 ¹
Klasse XU	10,4820	10,6176	11,3638
Klasse XUP	8,1382	8,6646	9,7360
Klasse ZEH	9,8420 ¹	10,3126 ¹	11,2373 ¹
Klasse ZU	9,0109	9,1782	–

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁴Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		91.108.424
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	57.551
Zinsen aus Anleihen, netto	2	3.467.411
Zinsen aus Bankguthaben	2	64.408
Zinsen aus Terminkontrakten		896
Erträge, insgesamt		3.590.266
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(489.696)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(3.239)
Betriebskosten	3, 5	(122.092)
Sonstige Gebühren	4	(6)
Aufwand, insgesamt		(615.033)
Nettoertrag aus Anlagen		2.975.233
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(5.204.832)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(1.494.902)
Realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten		(118.126)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(5.621)
Realisierter Netto(verlust)		(6.823.481)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(677.353)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(41.225)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Terminkontrakten		105.716
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(612.862)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(4.461.110)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		6.041.953
Anteilrücknahmen		(31.718.963)
Dividenden	7	(1.043.441)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(26.720.451)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		59.926.863

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	59.926.863	91.108.424	115.675.743

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	112.901.000
Bankguthaben	2	4.196.333
Forderungen aus Zeichnungen		75.907
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.878.296
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	727.720
Sonstige Aktiva		59
Aktiva, insgesamt		119.779.315
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(21.032)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(59.786)
Sonstige Passiva		(10.641)
Passiva, insgesamt		(91.459)
Nettovermögen, insgesamt		119.687.856

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEC	13.756,531
Klasse AEH	18.063,550
Klasse AKH	80,000
Klasse ANH	802,000
Klasse ASH	33.549,319
Klasse AU	89.995,944
Klasse AUP	210.482,229
Klasse DEC	12.740,268
Klasse DEH	19.397,812
Klasse DU	35.828,686
Klasse IEC	92,000
Klasse IEH	1.910.014,092
Klasse IKH	79,000
Klasse INH	789,000
Klasse ISC	395.606,558
Klasse IU	3.951.994,297
Klasse TEH	5.146,558
Klasse XUP	90,000
Klasse ZFH	82,000
Klasse ZGH	58,000
Klasse ZU	11.851,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		176.111.653
Ertrag		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	8.464.934
Zinsen aus Bankguthaben	2	150.271
Sonstige Erträge		1.800
Erträge, insgesamt		8.617.005
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(870.643)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(6.655)
Betriebskosten	3, 5	(159.807)
Aufwand, insgesamt		(1.037.105)
Nettoertrag aus Anlagen		7.579.900
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(7.722.822)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(3.634.854)
Realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten		(4)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		500.304
Realisierter Netto(verlust)		(10.857.376)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(6.275.992)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(65.679)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(6.341.671)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(9.619.147)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		24.347.190
Anteilrücknahmen		(70.897.147)
Dividenden	7	(254.693)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(46.804.650)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		119.687.856

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	119.687.856	176.111.653	210.577.608

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AEC	10,3123 ¹	11,6239 ¹	12,5108 ¹
Klasse AEH	30,0326 ¹	32,0422 ¹	32,7344 ¹
Klasse AKH	96,4111 ²	102,5833 ²	104,5429 ²
Klasse ANH	9,7797 ³	10,3445 ³	10,4867 ³
Klasse ASH	14,4742 ⁴	15,1131 ⁴	15,3006 ⁴
Klasse AU	36,5811	37,8984	38,3288
Klasse AUP	11,4723	12,5588	13,3803
Klasse DEC	7,7584 ¹	8,7567 ¹	9,4471 ¹
Klasse DEH	21,5485 ¹	23,0395 ¹	23,5798 ¹
Klasse DU	26,2017	27,1995	27,5635
Klasse IEC	7,6761 ¹	8,5796 ¹	9,1542 ¹
Klasse IEH	30,3547 ¹	32,1076 ¹	32,5065 ¹
Klasse IKH	99,5072 ²	104,9731 ²	105,9750 ²
Klasse INH	10,1091 ³	10,5900 ³	10,6374 ³
Klasse ISC	8,5672 ⁴	9,3701 ⁴	–
Klasse IU	11,5402	11,8564	11,8836
Klasse TEH	10,8358 ¹	11,4601 ¹	11,6033 ¹
Klasse XUP	9,6526	10,4751	10,9963
Klasse ZFH	10,2174 ⁵	10,8909 ⁵	11,0919 ⁵
Klasse ZGH	11,5898 ⁶	12,0954 ⁶	12,2029 ⁶
Klasse ZU	13,4244	13,8130	13,8794

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

²Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

³Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

⁴Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

⁵Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

⁶Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	36.763.905
Bankguthaben	2	1.475.420
Termineinlagen	2, 19	3.646.810
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		356.878
Forderungen aus Zeichnungen		300.513
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		349.037
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	197.394
Sonstige Aktiva		193
Aktiva, insgesamt		43.090.150
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(42.445)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(12.117)
Sonstige Passiva		(4.342)
Passiva, insgesamt		(58.904)
Nettovermögen, insgesamt		43.031.246

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	88.205,787
Klasse AKH	82,000
Klasse AS	1.486,300
Klasse ASC	5.226,779
Klasse ASH	42.594,720
Klasse AU	97.044,685
Klasse AUP	554.163,295
Klasse AVC	100,000
Klasse AVH	100,000
Klasse DEH	60.905,790
Klasse IEH	1.340.239,593
Klasse IGH	54,000
Klasse ISH	97,000
Klasse IU	41.197,659
Klasse XU	1.471.726,985
Klasse ZU	42.070,000
Klasse ZUP	92,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		57.454.754
Ertrag		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	1.780.826
Zinsen aus Bankguthaben	2	103.594
Zinsen aus Terminkontrakten		436
Sonstige Erträge		1
Erträge, insgesamt		1.884.857
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(148.344)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(2.526)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(95)
Betriebskosten	3, 5	(62.837)
Aufwand, insgesamt		(213.802)
Nettoertrag aus Anlagen		1.671.055
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(2.488.096)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(516.683)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		243.031
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(65.248)
Realisierter Netto(verlust)		(2.826.996)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(2.205.668)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		22.103
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Terminkontrakten		(66.057)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(2.249.622)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(3.405.563)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		5.149.313
Anteilrücknahmen		(15.922.622)
Dividenden	7	(244.636)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(11.017.945)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		43.031.246

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	43.031.246	57.454.754	68.819.183

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AEH	10,2955 ¹	11,1546 ¹	11,9604 ¹
Klasse AKH	89,4224 ²	96,2683 ²	102,8729 ²
Klasse AS	10,2715 ³	11,0373 ³	11,6426 ³
Klasse ASC	8,9050 ³	9,8517 ³	10,8641 ³
Klasse ASH	11,6360 ³	12,3554 ³	13,1327 ³
Klasse AU	11,9774	12,6431	13,4327
Klasse AUP	9,3483	10,2865	11,3378
Klasse AVC	8,4255 ⁴	9,3713 ⁴	10,3878 ⁴
Klasse AVH	10,1977 ⁴	10,8855 ⁴	11,6150 ⁴
Klasse DEH	9,9699 ¹	10,8323 ¹	11,6515 ¹
Klasse IEH	10,8634 ¹	11,6988 ¹	12,4708 ¹
Klasse IGH	11,7523 ⁵	12,4646 ⁵	13,1827 ⁵
Klasse ISH	12,3266 ³	13,0166 ³	13,7420 ³
Klasse IU	12,6617	13,2854	14,0310
Klasse XU	12,0581	12,6016	13,2554
Klasse ZU	12,6515	13,2836	14,0429
Klasse ZUP	9,0572	9,9161	10,8803

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

²Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

³Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

⁴Die Klasse lautet auf AUD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

⁵Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	441.234
Bankguthaben	2	70.958
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		3.268
Aktiva, insgesamt		515.460
Passiva		
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(93.528)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(10.421)
Sonstige Passiva		(3.604)
Passiva, insgesamt		(107.553)
Nettovermögen, insgesamt		407.907

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	19.286,564
Klasse DE	19.192,968

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	10,7963	11,5219	11,3495
Klasse AEP [#]	–	11,4169	11,2520
Klasse DE	10,4040	11,1869	11,1024
Klasse IE [#]	–	11,8436	11,5850
Klasse IEP [#]	–	11,7510	11,4878
Klasse LE [#]	–	11,9147	11,6371
Klasse LEP [#]	–	11,8287	11,5394
Klasse ZE [#]	–	11,7517	11,5196
Klasse ZEP [#]	–	11,6583	11,4285

[#]Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		33.700.769
Ertrag		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	88.346
Zinsen aus Bankguthaben	2	35.040
Sonstige Erträge		4
Erträge, insgesamt		123.390
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(184.331)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(5.195)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(5.100)
Betriebskosten	3, 5	(66.381)
Aufwand, insgesamt		(261.007)
Netto(verlust) aus Anlagen		(137.617)
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		2.217.490
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		123.337
Realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten		(555.793)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(84.550)
Realisierter Nettogewinn		1.700.484
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(3.594.581)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(87.400)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Terminkontrakten		(352.619)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(4.034.600)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(2.471.733)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		4.061.917
Anteilrücknahmen		(34.883.044)
Dividenden	7	(2)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(30.821.129)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		407.907

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
EUR	407.907	33.700.769	31.879.013

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	32.411.362
Bankguthaben	2	2.163.864
Termineinlagen	2, 19	1.411.301
Forderungen aus Zeichnungen		87
Zinsforderungen aus Swaps	2	9.759
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		122.413
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	183.181
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2, 10	96.637
Sonstige Aktiva		9.632
Aktiva, insgesamt		36.408.236
Passiva		
Überziehungskredite		(45)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(278.117)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(2.824)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(4.880)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten	2, 11	(314.687)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(39.443)
Sonstige Passiva		(8.278)
Passiva, insgesamt		(648.274)
Nettovermögen, insgesamt		35.759.962

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEC	61.474,388
Klasse AEH	279.961,193
Klasse AKH	74,000
Klasse AU	236.279,127
Klasse AUP	277.797,449
Klasse DEH	94.209,106
Klasse DU	162.881,488
Klasse IEH	11.053,874
Klasse IGH	24,000
Klasse IU	264.680,590
Klasse W	5.683,832
Klasse ZU	100,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AEC	11,8519 ¹	13,3778 ¹	14,0361 ¹
Klasse AEH	24,9127 ¹	27,7017 ¹	28,7145 ¹
Klasse AKH	97,4964 ²	108,2209 ²	112,0590 ²
Klasse AU	39,0428	42,0736	43,1173
Klasse AUP	14,3202	15,6687	16,2512
Klasse DEH	17,7549 ¹	19,8712 ¹	20,7320 ¹
Klasse DU	25,2586	27,3970	28,2598
Klasse IEH	9,8952 ¹	10,9147 ¹	11,2478 ¹
Klasse IGH	26,3907 ³	28,7174 ³	29,3439 ³
Klasse IU	29,3576	31,4158	31,9704
Klasse W	64,1635	69,2136	71,0014
Klasse ZU	8,8409	9,4818	–

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		44.823.256
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	272.012
Zinsen aus Anleihen, netto	2	206.149
Zinsen aus Bankguthaben	2	81.775
Zinsen aus Swaps		183.554
Erträge, insgesamt		743.490
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(506.399)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(17.379)
Zinsaufwand aus Swaps		(32.621)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(9.091)
Betriebskosten	3, 5	(105.866)
Aufwand, insgesamt		(671.356)
Nettoertrag aus Anlagen		72.134
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		1.725.976
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		62.731
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(1.718.964)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		905.155
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(300.854)
Realisierter Netto(verlust) aus Steuerrückforderungen		(138)
Realisierter Nettogewinn		673.906
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(5.199.802)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(183.126)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		203.320
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Terminkontrakten		497.655
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(4.681.953)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(3.935.913)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		5.416.481
Anteilrücknahmen		(10.467.659)
Dividenden	7	(76.203)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(5.127.381)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		35.759.962

GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
	35.759.962	44.823.256	58.030.727

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	102.806.032
Bankguthaben	2	6.486.496
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		312.977
Forderungen aus Zeichnungen		67.102
Zinsforderungen aus Swaps	2	1.761
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		650.054
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	105.827
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	2, 11	366.411
Sonstige Aktiva		42.312
Aktiva, insgesamt		110.838.972
Passiva		
Zum Marktwert verkaufte Optionen	2, 12	(377.061)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(555.674)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(212.242)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(2.161)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(5.730)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(132.294)
Sonstige Passiva		(36.910)
Passiva, insgesamt		(1.322.072)
Nettovermögen, insgesamt		109.516.900

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	56.817,964
Klasse AEC	4.181.222,806
Klasse AEH	609.190,670
Klasse AEP	2.210.186,318
Klasse AS	100,000
Klasse ASC	16.069,559
Klasse ASH	639,122
Klasse ASP	5.324,095
Klasse AU	374.518,833
Klasse AUM	40.835,903
Klasse AUP	940.558,501
Klasse DEC	2.242.637,357
Klasse DEH	234.640,747
Klasse DEP	230.012,621
Klasse DU	333.249,275
Klasse DUP	681.121,774
Klasse ZE	73,000
Klasse ZEC	93,000
Klasse ZEH	72.750,621
Klasse ZFH	85,000
Klasse ZU	4.008,949
Klasse ZUP	100,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		142.600.557
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.540.862
Zinsen aus Anleihen, netto	2	1.933.158
Zinsen aus Bankguthaben	2	143.405
Zinsen aus Swaps		53.261
Zinsen aus Terminkontrakten		175.420
Sonstige Erträge		113
Erträge, insgesamt		3.846.219
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.696.089)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(15.795)
Zinsaufwand aus Swaps		(62.971)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(86.425)
Betriebskosten	3, 5	(343.793)
Sonstige Gebühren	4	(1)
Aufwand, insgesamt		(2.205.074)
Nettoertrag aus Anlagen		1.641.145
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(7.203.234)
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		9.167
Realisierter Nettogewinn aus Optionen		365.179
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.234.162
Realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten		(88.402)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(1.088.305)
Realisierter Netto(verlust)		(6.771.433)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(5.786.684)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		20.687
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Optionen		24.932
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(740.533)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Terminkontrakten		(310.150)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(6.791.748)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(11.922.036)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		10.342.076
Anteilrücknahmen		(27.710.504)
Dividenden	7	(3.793.193)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(21.161.621)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		109.516.900

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	109.516.900	142.600.557	175.207.757

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	11,5541 ¹	11,8451 ¹	11,1664 ¹
Klasse AEC	6,8440 ¹	7,7505 ¹	8,1761 ¹
Klasse AEH	16,5540 ¹	17,9084 ¹	18,0258 ¹
Klasse AEP	8,7671 ¹	9,4049 ¹	9,2989 ¹
Klasse AS	10,4496 ²	11,1952 ²	11,0946 ²
Klasse ASC	8,2370 ²	9,1249 ²	9,5406 ²
Klasse ASH	10,4766 ²	11,0880 ²	11,0586 ²
Klasse ASP	8,1638 ²	9,1289 ²	9,4660 ²
Klasse AU	19,5536	20,5295	20,4434
Klasse AUM	8,8613	9,7159	10,1632
Klasse AUP	8,3706	9,1953	9,6048
Klasse DEC	6,4163 ¹	7,3229 ¹	7,7834 ¹
Klasse DEH	9,3527 ¹	10,1960 ¹	10,3401 ¹
Klasse DEP	8,1540 ¹	8,8122 ¹	8,7797 ¹
Klasse DU	11,9278	12,6175	12,6591
Klasse DUP	7,5370	8,3429	8,7793
Klasse ZE	11,8898 ¹	12,1429 ¹	11,3949 ¹
Klasse ZEC	7,6027 ¹	8,5885 ¹	9,0180 ¹
Klasse ZEH	10,0654 ¹	10,8301 ¹	10,8464 ¹
Klasse ZFH	9,8346 ³	10,6752 ³	10,7251 ³
Klasse ZU	11,5140	12,0281	11,9183
Klasse ZUP	8,4589	9,2576	9,6307

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

²Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

³Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	4.832.284
Bankguthaben	2	253.059
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		479
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		21.959
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	816
Sonstige Aktiva	20	33.653
Aktiva, insgesamt		5.142.250
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(2.555)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(2.896)
Sonstige Passiva		(603)
Passiva, insgesamt		(6.054)
Nettovermögen, insgesamt		5.136.196

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	100,000
Klasse AEC	100,000
Klasse AEH	9.236,091
Klasse AU	100,000
Klasse AUP	100,000
Klasse IE	100,000
Klasse IEH	100,000
Klasse IG	100,000
Klasse IU	100,000
Klasse LE	97.000,000
Klasse LG	100,000
Klasse XU	100,000
Klasse ZE	100,000
Klasse ZEC	100,000
Klasse ZEH	100,000
Klasse ZU	498.187,100
Klasse ZUP	100,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	8,6814 ¹	10,1300 ¹	13,1238 ¹
Klasse AEC	7,3738 ¹	9,3082 ¹	13,0744 ¹
Klasse AEH	7,6264 ¹	9,4264 ¹	13,1208 ¹
Klasse AU	8,0834	9,6534	13,2113
Klasse AUP	7,8220	9,5286	13,1684
Klasse IE	8,8953 ¹	10,2725 ¹	13,1851 ¹
Klasse IEH	7,8154 ¹	9,5604 ¹	13,1794 ¹
Klasse IG	8,5458 ²	9,4923 ²	12,2808 ²
Klasse IU	8,2860	9,7979	13,2780
Klasse LE	8,9650 ¹	10,3264 ¹	13,2092 ¹
Klasse LG	8,6130 ²	9,5344 ²	12,2989 ²
Klasse XU	8,4163	9,8914	13,3214
Klasse ZE	8,8591 ¹	10,2464 ¹	13,1739 ¹
Klasse ZEC	7,5103 ¹	9,4153 ¹	13,1241 ¹
Klasse ZEH	7,7713 ¹	9,5353 ¹	13,1675 ¹
Klasse ZU	8,2349	9,7613	13,2623
Klasse ZUP	7,9637	9,6378	13,2192

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		6.094.426
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	81.634
Zinsen aus Bankguthaben	2	4.983
Erträge, insgesamt		86.617
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(35.610)
Betriebskosten	3, 5	(9.711)
Aufwand, insgesamt		(45.321)
Nettoertrag aus Anlagen		41.296
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(821.291)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(5.487)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(3.106)
Realisierter Netto(verlust)		(829.884)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(165.251)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(240)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(165.491)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(954.079)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		508
Anteilrücknahmen		(4.598)
Dividenden	7	(61)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(4.151)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		5.136.196

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	5.136.196	6.094.426	9.412.889

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.853.829.794
Bankguthaben	2	3.068.643
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		7.319.697
Forderungen aus Zeichnungen		1.123.378
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		2.437.986
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	1.869.364
Sonstige Aktiva	20	739.993
Aktiva, insgesamt		1.870.388.855
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(4.857.089)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(1.960.748)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.737.830)
Sonstige Passiva		(237.785)
Passiva, insgesamt		(8.793.452)
Nettovermögen, insgesamt		1.861.595.403

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	1.427.641,871
Klasse AEP	4.022.716,513
Klasse ASH	88.568,115
Klasse AU	6.704.765,850
Klasse AUP	34.292,333
Klasse DEH	737.762,471
Klasse DU	1.516.437,783
Klasse IE	5.387.913,894
Klasse IEH	3.964.562,783
Klasse IU	25.682.526,076
Klasse IUP	51.356,992
Klasse W	4.738,351
Klasse XU	2.762.066,512
Klasse ZE	4.434.997,017
Klasse ZEH	243.060,968
Klasse ZEP	3.744.094,085
Klasse ZFH	75,000
Klasse ZG	608.086,828
Klasse ZU	663.955,692

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		2.405.094.415
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	18.797.252
Zinsen aus Bankguthaben	2	175.757
Sonstige Erträge		370
Erträge, insgesamt		18.973.379
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(20.848.148)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(48.665)
Betriebskosten	3, 5	(3.565.898)
Aufwand, insgesamt		(24.462.711)
Netto(verlust) aus Anlagen		(5.489.332)
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(106.284.065)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(10.540.289)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		370.792
Realisierter Netto(verlust) aus Steuerrückforderungen		(188)
Realisierter Netto(verlust)		(116.453.750)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(126.431.618)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(4.820)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(126.436.438)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(248.379.520)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		587.900.273
Anteilrücknahmen		(881.035.864)
Dividenden	7	(1.983.901)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(295.119.492)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		1.861.595.403

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	1.861.595.403	2.405.094.415	1.676.310.766

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AEH	52,8087 ¹	60,3566 ¹	57,4173 ¹
Klasse AEP	19,5948 ¹	21,3430 ¹	19,1012 ¹
Klasse ASH ²	9,9814 ²	–	–
Klasse AU	93,4160	102,8279	96,5311
Klasse AUP	14,6282	16,3197	15,4283
Klasse DEH	37,5629 ¹	43,2512 ¹	41,4515 ¹
Klasse DU	47,8351	53,0512	50,1776
Klasse IE	19,5074 ¹	20,7896 ¹	18,3198 ¹
Klasse IEH	14,4633 ¹	16,3912 ¹	15,4630 ¹
Klasse IU	19,4038	21,1779	19,7127
Klasse IUP	15,2319	16,8469	15,7922
Klasse W	142,8921	157,1578	147,4604
Klasse XU	22,8844	24,7993	22,8996
Klasse ZE	21,9599 ¹	23,4189 ¹	20,6574 ¹
Klasse ZEH	10,4027 ¹	11,7932 ¹	11,1310 ¹
Klasse ZEP	20,4842 ¹	22,1355 ¹	19,6580 ¹
Klasse ZFH	10,3229 ³	11,7503 ³	11,1109 ³
Klasse ZG	22,5389 ⁴	23,1166 ⁴	20,5546 ⁴
Klasse ZU	23,4612	25,6233	23,8745

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

²Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

³Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

⁴Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

⁵Siehe Erläuterung 1.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	342.123.884
Bankguthaben	2	8.086.511
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		17.506
Forderungen aus Zeichnungen		1.108
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.235.304
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	20.726
Sonstige Aktiva	20	2.330.687
Aktiva, insgesamt		353.815.726
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(11.223)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(69.895)
Sonstige Passiva		(28.611)
Passiva, insgesamt		(109.729)
Nettovermögen, insgesamt		353.705.997

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	16.393,606
Klasse AU	34.541,373
Klasse DEH	47.894,407
Klasse DU	63.604,139
Klasse IE	33.292,215
Klasse IEH	41.024,410
Klasse IU	4.747.899,224
Klasse XU	29.731.456,869
Klasse ZU	127.516,669
Klasse 1E	3.134.661,702
Klasse 1U	2.236.201,250
Klasse 2E	2.016.097,894
Klasse 2U	53,000
Klasse 8E	390,015
Klasse 8U	1.640.029,266

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AEH	24,5593 ¹	29,8455 ¹	42,3802 ¹
Klasse AU	41,7317	48,9816	68,3931
Klasse DEH	17,2383 ¹	21,1131 ¹	30,1969 ¹
Klasse DU	28,7652	34,0169	47,8562
Klasse IE	10,4209 ¹	11,8421 ¹	15,5210 ¹
Klasse IEH	15,0434 ¹	18,1198 ¹	25,5028 ¹
Klasse IU	10,1101	11,7660	16,2895
Klasse XU	8,8771	10,2512	–
Klasse ZU	9,6637	11,2539	15,5962
Klasse 1E	1,2435 ¹	1,4248 ¹	1,8817 ¹
Klasse 1U	1,3508	1,5851	2,2113
Klasse 2E	11,4983 ¹	13,0947 ¹	17,1886 ¹
Klasse 2U	11,0215	12,8579	17,8242
Klasse 8E	1,3737 ¹	1,5656 ¹	2,0559 ¹
Klasse 8U	1,4931	1,7421	2,4165

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		134.106.881
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	4.254.148
Zinsen aus Bankguthaben	2	233.375
Sonstige Erträge		586.590
Erträge, insgesamt		5.074.113
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(943.672)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(5.003)
Betriebskosten	3, 5	(352.555)
Aufwand, insgesamt		(1.301.230)
Nettoertrag aus Anlagen		3.772.883
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(29.933.966)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(116.470)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(198.004)
Realisierter Netto(verlust)		(30.248.440)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(14.528.395)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(1.848)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(14.530.243)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(41.005.800)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		302.224.814
Anteilrücknahmen		(41.619.898)
Kapitalbewegungen, insgesamt		260.604.916
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		353.705.997

GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
	353.705.997	134.106.881	170.104.097

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	167.602.520
Bankguthaben	2	303.605
Forderungen aus Zeichnungen		153.508
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		380.373
Nicht realisierter Nettogewinn aus		
Devisenterminkontrakten	2, 9	54.167
Sonstige Aktiva	20	155.360
Aktiva, insgesamt		168.649.533
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(86.331)
Verbindlichkeiten aus		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(142.165)
Sonstige Passiva		(24.022)
Passiva, insgesamt		(252.518)
Nettovermögen, insgesamt		168.397.015

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEC	326,000
Klasse AUP	84,000
Klasse DEC	77,000
Klasse DUP	49.298,838
Klasse IU	218.786,000
Klasse TE	66,000
Klasse ZU	75,000
Klasse 1E	1.625.996,038
Klasse 1EP	1.424.333,754
Klasse 1SC	434.065,976
Klasse 1SH	36.070,165
Klasse 1ST	80.840,493
Klasse 1U	321.124,663
Klasse 1UP	396.270,792
Klasse 1VT	5.746,136
Klasse 2E	760.261,534
Klasse 2EP	72,000
Klasse 2U	75,000
Klasse 2UP	82,000
Klasse 3E	140.997,353
Klasse 3EP	7.208.679,900
Klasse 3U	9.575,003
Klasse 3UP	20.172,115
Klasse 8E	119.354,234
Klasse 8EP	236,808
Klasse 8U	8.233,578
Klasse 8UP	105.481,704
Klasse 9E	65,000
Klasse 9EP	72,000
Klasse 9U	74,000
Klasse 9UP	82,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		215.918.713
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	4.283.771
Zinsen aus Bankguthaben	2	44.133
Sonstige Erträge		320
Erträge, insgesamt		4.328.224
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.740.683)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(1.041)
Betriebskosten	3, 5	(299.467)
Aufwand, insgesamt		(2.041.191)
Nettoertrag aus Anlagen		2.287.033
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(2.724.776)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(33.831)
Realisierter Netto(verlust)		(2.758.607)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(9.308.678)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		7.909
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(9.300.769)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(9.772.343)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		18.729.941
Anteilrücknahmen		(52.847.962)
Dividenden	7	(3.631.334)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(37.749.355)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		168.397.015

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	168.397.015	215.918.713	220.612.038

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AEC	9,7529 ¹	10,9032 ¹	10,8646 ¹
Klasse AUP	10,8746	11,7207	11,5197
Klasse DEC	9,5329 ¹	10,7205 ¹	10,7367 ¹
Klasse DUP	10,6321	11,5104	11,3689
Klasse IU	13,0416	13,5078	12,8194
Klasse TE	13,6889 ¹	13,8508 ¹	12,4675 ¹
Klasse ZU	12,9971	13,4839	12,8038
Klasse 1E	13,3500 ¹	13,6005 ¹	12,3011 ¹
Klasse 1EP	11,5606 ¹	12,1468 ¹	11,2887 ¹
Klasse 1SC	10,5266 ²	11,4630 ²	11,2960 ²
Klasse 1SH	12,1716 ²	12,8545 ²	12,3246 ²
Klasse 1ST	10,5621 ²	11,4849 ²	11,3150 ²
Klasse 1U	12,6598	13,2084	12,6191
Klasse 1UP	10,9443	11,7772	11,5601
Klasse 1VT	10,0908 ³	11,1290 ³	11,0336 ³
Klasse 2E	13,9684 ¹	14,1440 ¹	12,7149 ¹
Klasse 2EP	11,9014 ¹	12,4187 ¹	11,4725 ¹
Klasse 2U	13,0009	13,4831	12,8080
Klasse 2UP	11,2898	12,0644	11,7699
Klasse 3E	13,8013 ¹	13,9552 ¹	12,5276 ¹
Klasse 3EP	11,9519 ¹	12,4603 ¹	11,4904 ¹
Klasse 3U	13,0876	13,5528	12,8514
Klasse 3UP	11,3470	12,1163	11,8020
Klasse 8E	13,6859 ¹	13,8635 ¹	12,4677 ¹
Klasse 8EP	11,8295 ¹	12,3593 ¹	11,4170 ¹
Klasse 8U	12,9818	13,4674	12,7934
Klasse 8UP	11,2439	12,0275	11,7367
Klasse 9E	13,8492 ¹	13,9945 ¹	12,5555 ¹
Klasse 9EP	11,9987 ¹	12,4988 ¹	11,5171 ¹
Klasse 9U	13,1489	13,6064	12,8935
Klasse 9UP	11,3777	12,1372	11,8108

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

²Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

³Die Klasse lautet auf AUD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

Threadneedle (Lux) - Global Select

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	581.342.531
Bankguthaben	2	1.435.988
Forderungen aus Zeichnungen		56.476
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.108.005
Sonstige Aktiva	20	219.772
Aktiva, insgesamt		584.162.772
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(10.335.752)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(393.923)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(595.941)
Sonstige Passiva		(70.749)
Passiva, insgesamt		(11.396.365)
Nettovermögen, insgesamt		572.766.407

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse IU	63.166,202
Klasse ZU	1.378,995
Klasse 1E	22.052.128,904
Klasse 1U	64.240.462,842
Klasse 2E	308.507,753
Klasse 2U	2.988.061,507
Klasse 3U	9.525.570,701
Klasse 8E	63.716,592
Klasse 8U	22.466.748,119
Klasse 9U	2.167.420,935

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse IU	13,9844	15,7040	15,4100
Klasse ZU	13,9429	15,6678	15,3846
Klasse 1E	3,5100 ¹	3,8796 ¹	3,6305 ¹
Klasse 1U	3,8129	4,3160	4,2662
Klasse 2E	14,6149 ¹	16,0460 ¹	14,9212 ¹
Klasse 2U	13,9132	15,6533	15,3787
Klasse 3U	4,1009	4,6059	4,5175
Klasse 8E	5,1839 ¹	5,6972 ¹	5,3010 ¹
Klasse 8U	5,6311	6,3379	6,2292
Klasse 9U	14,0355	15,7566	15,4477

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		609.163.562
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	6.874.698
Zinsen aus Bankguthaben	2	61.913
Sonstige Erträge		43
Erträge, insgesamt		6.936.654
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(6.694.640)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(8.927)
Betriebskosten	3, 5	(807.216)
Aufwand, insgesamt		(7.510.783)
Netto(verlust) aus Anlagen		(574.129)
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(6.034.796)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		5.227
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		99.814
Realisierter Netto(verlust)		(5.929.755)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(60.066.305)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(60.066.305)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(66.570.189)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		137.576.486
Anteilrücknahmen		(107.403.452)
Kapitalbewegungen, insgesamt		30.173.034
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		572.766.407

GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
	572.766.407	609.163.562	605.915.496

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.685.070.914
Bankguthaben	2	1.342.668
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.360.576
Forderungen aus Zeichnungen		6.889.249
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.281.063
Sonstige Aktiva	20	350.195
Aktiva, insgesamt		1.696.294.665
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(6.219.076)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(1.427.461)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(53.987)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.645.618)
Sonstige Passiva		(375.818)
Passiva, insgesamt		(9.721.960)
Nettovermögen, insgesamt		1.686.572.705

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	14.522.792,970
Klasse AEP	22.888.881,947
Klasse AK	1.051.687,406
Klasse AUP	68.493,848
Klasse DE	1.734.284,581
Klasse IE	5.790.708,485
Klasse IEP	2.540.195,052
Klasse NE	6.060.120,000
Klasse XE	1.529.301,228
Klasse XFH	78,000
Klasse XG	41,000
Klasse XGH	30,000
Klasse XU	5.717.517,656
Klasse ZE	1.992.369,249
Klasse ZFH	328.953,539
Klasse ZG	1.663.920,776
Klasse ZGH	66.405,043
Klasse ZU	5.551.812,150

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		1.892.718.184
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	12.205.381
Zinsen aus Bankguthaben	2	81.580
Sonstige Erträge		1.957
Erträge, insgesamt		12.288.918
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(19.137.829)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(7.954)
Betriebskosten	3, 5	(4.397.196)
Aufwand, insgesamt		(23.542.979)
Netto(verlust) aus Anlagen		(11.254.061)
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(109.239.887)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.028.891
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		684.503
Realisierter Netto(verlust)		(107.526.493)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(15.931.848)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(337.793)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(16.269.641)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(135.050.195)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		420.543.783
Anteilrücknahmen		(488.530.829)
Dividenden	7	(3.108.238)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(71.095.284)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		1.686.572.705

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
EUR	1.686.572.705	1.892.718.184	2.108.588.124

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	42,3307	45,6690	47,2890
Klasse AEP	13,7161	14,9359	15,5848
Klasse AK	124,8571 ¹	123,9807 ¹	126,8311 ¹
Klasse AUP	12,6530 ²	14,1101 ²	15,5516 ²
Klasse DE	31,9592	34,6525	36,0617
Klasse IE	62,3619	66,7097	68,4913
Klasse IEP	11,7372	12,6727	13,1106
Klasse NE	13,7328	14,6609	15,0223
Klasse XE	16,0222	17,0020	17,3169
Klasse XFH	10,5007 ³	11,2077 ³	11,4338 ³
Klasse XG	16,0392 ⁴	16,3517 ⁴	16,7790 ⁴
Klasse XGH	22,0720 ⁴	23,1206 ⁴	23,4350 ⁴
Klasse XU	9,7326 ²	10,5772 ²	11,3797 ²
Klasse ZE	15,3242	16,4090	16,8641
Klasse ZFH	14,9779 ³	16,1495 ³	16,6452 ³
Klasse ZG	15,3455 ⁴	15,8031 ⁴	16,3719 ⁴
Klasse ZGH	45,1878 ⁴	47,7950 ⁴	48,9276 ⁴
Klasse ZU	14,1168 ²	15,4806 ²	16,8058 ²

¹Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

²Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

³Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

⁴Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

Threadneedle (Lux) - American

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.054.468.199
Bankguthaben	2	2.129.191
Forderungen aus Zeichnungen		545.614
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		650.555
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	1.915.892
Aktiva, insgesamt		1.059.709.451
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(590.406)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(916.219)
Sonstige Passiva		(165.864)
Passiva, insgesamt		(1.672.489)
Nettovermögen, insgesamt		1.058.036.962

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	2.213.076,297
Klasse AU	280.544,216
Klasse DEH	44.016,944
Klasse DU	610.689,401
Klasse IEH	548.188,745
Klasse IU	5.488.882,160
Klasse W	1.598,035
Klasse ZE	19.308,359
Klasse ZEH	2.114.294,299
Klasse ZU	60,000
Klasse 1E	2.538.878,247
Klasse 1EH	76.038,808
Klasse 1EP	311.033,567
Klasse 1U	11.864.112,005
Klasse 2E	549.548,222
Klasse 2U	8.300.540,060
Klasse 3EH	34.852,469
Klasse 3U	139.994,550
Klasse 8E	449.826,278
Klasse 8U	544.135,187
Klasse 9EH	55,000
Klasse 9U	364.819,350

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		1.241.417.577
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	11.179.480
Zinsen aus Bankguthaben	2	110.174
Erträge, insgesamt		11.289.654
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(11.337.989)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(10.475)
Betriebskosten	3, 5	(2.062.268)
Aufwand, insgesamt		(13.410.732)
Netto(verlust) aus Anlagen		(2.121.078)
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		30.883.946
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(12.263.865)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(512.743)
Realisierter Nettogewinn		18.107.338
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(154.112.696)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		21.480
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(154.091.216)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(138.104.956)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		513.060.714
Anteilrücknahmen		(558.260.709)
Dividenden	7	(75.664)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(45.275.659)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		1.058.036.962

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	1.058.036.962	1.241.417.577	1.120.251.631

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AEH	58,8005 ¹	67,7231 ¹	62,4805 ¹
Klasse AU	106,4713	118,2788	107,7058
Klasse DEH	43,1697 ¹	49,9448 ¹	46,2355 ¹
Klasse DU	41,1268	45,8481	41,8962
Klasse IEH	64,4833 ¹	73,6686 ¹	67,3710 ¹
Klasse IU	73,9691	81,4356	73,4915
Klasse W	142,5123	157,8424	143,3024
Klasse ZE	16,4747 ¹	17,7345 ¹	15,1672 ¹
Klasse ZEH	13,7004 ¹	15,6669 ¹	14,3367 ¹
Klasse ZU	15,4537	17,0528	15,4031
Klasse 1E	15,6752 ¹	16,9814 ¹	14,6201 ¹
Klasse 1EH	13,2250 ¹	15,2219 ¹	14,0242 ¹
Klasse 1EP	14,6508 ¹	16,1234 ¹	14,0455 ¹
Klasse 1U	14,7080	16,3179	14,8399
Klasse 2E	16,1119 ¹	17,3483 ¹	14,8451 ¹
Klasse 2U	15,1153	16,6678	15,0659
Klasse 3EH	13,6917 ¹	15,6415 ¹	14,2960 ¹
Klasse 3U	15,2372	16,7719	15,1327
Klasse 8E	16,0815 ¹	17,3225 ¹	14,8290 ¹
Klasse 8U	15,0839	16,6398	15,0466
Klasse 9EH	13,7283 ¹	15,6785 ¹	14,3200 ¹
Klasse 9U	15,2580	16,7881	15,1413

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

Threadneedle (Lux) - American Select

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	330.705.270
Bankguthaben	2	1.220.867
Termineinlagen	2, 19	5.001.325
Forderungen aus Zeichnungen		25.733
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		326.155
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	16.587
Aktiva, insgesamt		337.295.937
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(92.641)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(408.968)
Sonstige Passiva		(47.276)
Passiva, insgesamt		(548.885)
Nettovermögen, insgesamt		336.747.052

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AD	405,000
Klasse AEH	15.035,842
Klasse AN	524,000
Klasse AU	127.456,818
Klasse DEH	16.847,894
Klasse DU	90.644,247
Klasse ID	399,000
Klasse IE	54,000
Klasse IEH	4.765,789
Klasse IN	517,000
Klasse W	4.870,367
Klasse ZEH	53,000
Klasse ZU	8.884,396
Klasse 1E	12.746.178,468
Klasse 1EH	63.824,804
Klasse 1EP	380.361,416
Klasse 1U	37.872.414,659
Klasse 2EH	712,000
Klasse 2U	1.619,818
Klasse 3E	831.550,449
Klasse 3U	755.689,298
Klasse 8EH	4.562,812
Klasse 8U	1.857.228,876
Klasse 9E	50,000
Klasse 9U	3.235,874

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		413.688.020
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	3.662.492
Zinsen aus Bankguthaben	2	254.248
Erträge, insgesamt		3.916.740
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(5.043.850)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(567)
Betriebskosten	3, 5	(582.430)
Aufwand, insgesamt		(5.626.847)
Netto(verlust) aus Anlagen		(1.710.107)
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(32.938.293)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(115.969)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		8.328
Realisierter Netto(verlust)		(33.045.934)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(17.431.050)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(7.893)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(17.438.943)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(52.194.984)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		22.616.857
Anteilrücknahmen		(47.328.161)
Dividenden	7	(34.680)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(24.745.984)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		336.747.052

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	336.747.052	413.688.020	438.535.319

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Select

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AD	14,4184 ¹	16,1001 ¹	14,0643 ¹
Klasse AEH	36,3897 ²	43,2612 ²	40,4315 ²
Klasse AN	17,0195 ³	16,2724 ³	14,6605 ³
Klasse AU	34,9515	39,9888	36,9044
Klasse DEH	24,5242 ²	29,3649 ²	27,6535 ²
Klasse DU	30,3579	34,9947	32,5387
Klasse ID	14,8718 ¹	16,4501 ¹	14,2588 ¹
Klasse IE	14,9055 ²	16,5155 ²	14,3186 ²
Klasse IEH	39,2277 ²	46,2659 ²	42,8992 ²
Klasse IN	17,5368 ³	16,6107 ³	14,8493 ³
Klasse W	37,0021	42,3137	39,0305
Klasse ZEH	13,1870 ²	15,5785 ²	14,4664 ²
Klasse ZU	14,9153	16,9458	15,5296
Klasse 1E	5,5378 ²	6,1787 ²	5,3911 ²
Klasse 1EH	3,8663 ²	4,5896 ²	4,2840 ²
Klasse 1EP	5,2544 ²	5,9576 ²	5,2548 ²
Klasse 1U	6,0164	6,8745	6,3360
Klasse 2EH	13,6558 ²	16,1111 ²	14,9450 ²
Klasse 2U	15,1476	17,2032	15,7585
Klasse 3E	4,5811 ²	5,0705 ²	4,3890 ²
Klasse 3U	4,9770	5,6415	5,1582
Klasse 8EH	3,4274 ²	4,0452 ²	3,7559 ²
Klasse 8U	6,9957	7,9480	7,2838
Klasse 9E	15,9996 ²	17,7121 ²	15,3150 ²
Klasse 9U	15,3123	17,3500	15,8570

¹Die Klasse lautet auf DKK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

²Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

³Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	459.733.127
Bankguthaben	2	1.037.476
Forderungen aus Zeichnungen		254.439
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		61.710
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	694.141
Aktiva, insgesamt		461.780.893
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(169.880)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(386.719)
Sonstige Passiva		(65.108)
Passiva, insgesamt		(621.707)
Nettovermögen, insgesamt		461.159.186

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	146.813,264
Klasse ASH	135,000
Klasse AU	64.714,138
Klasse DEH	19.309,039
Klasse DU	59.936,971
Klasse IE	7.475.903,485
Klasse IU	1.185.843,630
Klasse ZU	16.039,182
Klasse 1E	562.304,921
Klasse 1EP	1.120.043,835
Klasse 1U	6.263.232,085
Klasse 2U	1.506.944,461
Klasse 3EH	4.009,863
Klasse 3U	903.916,074
Klasse 8U	1.233.977,903
Klasse 9EH	3.812.813,617
Klasse 9U	2.870.809,609

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AEH	14,5673 ¹	16,5581 ¹	16,6368 ¹
Klasse ASH ²	9,7371 ²	–	–
Klasse AU	16,2313	17,7793	17,6124
Klasse DEH	14,2416 ¹	16,2757 ¹	16,4357 ¹
Klasse DU	15,8822	17,4841	17,4069
Klasse IE	16,1245 ¹	17,1002 ¹	15,9009 ¹
Klasse IU	16,8585	18,3099	17,9845
Klasse ZU	16,7987	18,2631	17,9572
Klasse 1E	17,2458 ¹	18,4235 ¹	17,2570 ¹
Klasse 1EP	16,1333 ¹	17,4744 ¹	16,5639 ¹
Klasse 1U	16,3330	17,8692	17,6803
Klasse 2U	16,7817	18,2483	17,9455
Klasse 3EH	15,1814 ¹	17,0721 ¹	17,0018 ¹
Klasse 3U	16,8822	18,3319	18,0025
Klasse 8U	16,7598	18,2318	17,9365
Klasse 9EH	15,2029 ¹	17,1199 ¹	17,0449 ¹
Klasse 9U	16,9176	18,3630	18,0258

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		336.365.358
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	3.488.382
Zinsen aus Bankguthaben	2	58.021
Erträge, insgesamt		3.546.403
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(3.476.243)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(1.323)
Betriebskosten	3, 5	(510.241)
Aufwand, insgesamt		(3.987.807)
Netto(verlust) aus Anlagen		(441.404)
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		3.179.890
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(1.341.762)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(142.830)
Realisierter Nettogewinn		1.695.298
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(39.221.286)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		536.115
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(38.685.171)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(37.431.277)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		246.490.096
Anteilrücknahmen		(83.999.905)
Dividenden	7	(265.086)
Kapitalbewegungen, insgesamt		162.225.105
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		461.159.186

GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
	461.159.186	336.365.358	317.052.344

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	42.950.164
Bankguthaben	2	759.917
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		149.575
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	4.099
Sonstige Aktiva	20	530.884
Aktiva, insgesamt		44.394.639
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.361)
Steuerverbindlichkeit	3	(25.824)
Sonstige Passiva		(5.686)
Passiva, insgesamt		(32.871)
Nettovermögen, insgesamt		44.361.768

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	1.735,856
Klasse AF	51,000
Klasse AS	938,481
Klasse ASH	32.070,823
Klasse AU	11.475,833
Klasse DE	25.118,613
Klasse IF	49,000
Klasse ISH	71,000
Klasse IU	51,000
Klasse XU	1.237.862,746
Klasse XUP	2.557.578,913
Klasse ZE	45,000
Klasse ZEH	3.844,269
Klasse ZF	49,000
Klasse ZG	60,000
Klasse ZU	4.199,804

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	13,9231 ¹	15,4485 ¹	18,3066 ¹
Klasse AF	12,7109 ²	14,5713 ²	18,6638 ²
Klasse AS	9,9397 ³	11,4961 ³	14,2865 ³
Klasse ASH	12,3807 ³	14,2590 ³	17,9279 ³
Klasse AU	13,2011	15,0003	18,7762
Klasse DE	13,0775 ¹	14,6194 ¹	17,4547 ¹
Klasse IF	13,5353 ²	15,3389 ²	19,4667 ²
Klasse ISH	13,3286 ³	15,2033 ³	18,9488 ³
Klasse IU	14,1624	15,9526	19,7990
Klasse XU	10,8872	12,1685	14,9820
Klasse XUP	11,7028	13,4480	16,9577
Klasse ZE	14,7099 ¹	16,2137 ¹	19,0713 ¹
Klasse ZEH	11,8918 ¹	13,8883 ¹	17,5088 ¹
Klasse ZF	13,4629 ²	15,3088 ²	19,4570 ²
Klasse ZG	9,6689 ⁴	10,2500 ⁴	12,1521 ⁴
Klasse ZU	14,0938	15,8950	19,7473

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁴Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		95.614.006
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.401.445
Zinsen aus Bankguthaben	2	22.346
Sonstige Erträge		246.030
Erträge, insgesamt		1.669.821
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(21.353)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(589)
Betriebskosten	3, 5	(91.494)
Aufwand, insgesamt		(113.436)
Nettoertrag aus Anlagen		1.556.385
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(2.851.035)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(13.564)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		32.773
Realisierter Netto(verlust)		(2.831.826)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(9.704.069)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		938
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(9.703.131)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(10.978.572)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		11.295.110
Anteilrücknahmen		(50.824.521)
Dividenden	7	(744.255)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(40.273.666)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		44.361.768

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	44.361.768	95.614.006	188.088.458

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	115.440.088
Bankguthaben	2	787.228
Forderungen aus Zeichnungen		1.262
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		412.537
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	13
Sonstige Aktiva	20	1.383.325
Aktiva, insgesamt		118.024.453
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(713.789)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(69.160)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(121.005)
Sonstige Passiva		(17.249)
Passiva, insgesamt		(921.203)
Nettovermögen, insgesamt		117.103.250

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	83,000
Klasse AEH	83,000
Klasse DE	83,000
Klasse DEH	83,000
Klasse IE	554.785,299
Klasse IU	188.889,492
Klasse ZU	19.857,424
Klasse 1E	1.178.423,101
Klasse 1U	22.268.734,091
Klasse 2E	55,000
Klasse 2U	1.583.661,487
Klasse 3U	4.101.843,604
Klasse 8E	670,407
Klasse 8U	1.691.627,638
Klasse 9U	131.715,243

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	7,794 ¹	8,9696 ¹	–
Klasse AEH	6,6394 ¹	8,0913 ¹	–
Klasse DE	7,7281 ¹	8,9361 ¹	–
Klasse DEH	6,5830 ¹	8,0618 ¹	–
Klasse IE	11,2413 ¹	12,8045 ¹	14,5096 ¹
Klasse IU	11,4782	13,3897	16,0271
Klasse ZU	11,4362	13,3540	16,0024
Klasse 1E	2,7919 ¹	3,2041 ¹	3,6581 ¹
Klasse 1U	3,0330	3,5648	4,2991
Klasse 2E	11,9878 ¹	13,6717 ¹	15,5085 ¹
Klasse 2U	11,4208	13,3414	15,9916
Klasse 3U	2,7558	3,2148	3,8480
Klasse 8E	3,2110 ¹	3,6646 ¹	4,1593 ¹
Klasse 8U	3,4904	4,0790	4,8912
Klasse 9U	11,5069	13,4178	16,0542

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		142.380.978
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.777.190
Zinsen aus Bankguthaben	2	40.660
Sonstige Erträge		518.334
Erträge, insgesamt		3.336.184
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.501.491)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(337)
Betriebskosten	3, 5	(213.337)
Sonstige Gebühren	4	(265)
Aufwand, insgesamt		(1.715.430)
Nettoertrag aus Anlagen		1.620.754
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(10.513.890)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(8.257)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(52.945)
Realisierter Netto(verlust)		(10.575.092)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(11.774.789)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(3)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(11.774.792)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(20.729.130)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		21.492.955
Anteilrücknahmen		(26.041.553)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(4.548.598)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		117.103.250

GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
	117.103.250	142.380.978	343.930.526

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	260.750.521
Bankguthaben	2	6.443.734
Forderungen aus Zeichnungen		88.188
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		140.089
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	970.551
Aktiva, insgesamt		268.393.083
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(389.533)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(127.107)
Sonstige Passiva		(55.881)
Passiva, insgesamt		(572.521)
Nettovermögen, insgesamt		267.820.562

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEC	52,844
Klasse AEH	22.892,032
Klasse AU	75.775,028
Klasse AUP	8.906,274
Klasse DU	6.382,200
Klasse IU	1.426.416,499
Klasse XS	69,000
Klasse XSH	5.242.486,638
Klasse ZEH	338.028,006
Klasse ZFH	48,000
Klasse ZGH	35,000
Klasse ZU	3.592.736,411

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AEC	16,0772 ¹	18,8839 ¹	17,5161 ¹
Klasse AEH	27,0377 ¹	31,2589 ¹	28,6186 ¹
Klasse AU	51,7687	57,7098	52,1802
Klasse AUP	18,4680	20,8998	19,1464
Klasse DU	25,5801	28,6587	26,0427
Klasse IU	75,5875	83,5904	74,9789
Klasse XS	18,3141 ²	20,4221 ²	18,0154 ²
Klasse XSH	18,5872 ²	20,6253 ²	18,3848 ²
Klasse ZEH	17,8024 ³	20,4263 ³	18,5596 ³
Klasse ZFH	17,3160 ³	19,9729 ³	18,1775 ³
Klasse ZGH	18,7761 ⁴	21,2839 ⁴	19,2281 ⁴
Klasse ZU	20,9441	23,1731	20,7962

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁴Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		379.069.017
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.672.162
Zinsen aus Bankguthaben	2	175.047
Erträge, insgesamt		2.847.209
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.643.430)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(7.796)
Betriebskosten	3, 5	(709.165)
Aufwand, insgesamt		(2.360.391)
Nettoertrag aus Anlagen		486.818
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		22.159.580
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(707.868)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(61.135)
Realisierter Nettogewinn		21.390.577
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(59.348.888)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(93.723)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(59.442.611)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(37.565.216)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		45.664.053
Anteilirücknahmen		(119.344.926)
Dividenden	7	(2.366)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(73.683.239)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		267.820.562

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	267.820.562	379.069.017	484.292.226

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	125.538.670
Bankguthaben	2	1.531.165
Forderungen aus Zeichnungen		135.036
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		74.286
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	5.416
Aktiva, insgesamt		127.284.573
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(155.246)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(10.676)
Sonstige Passiva		(10.537)
Passiva, insgesamt		(176.459)
Nettovermögen, insgesamt		127.108.114

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	1.819,435
Klasse AEH	54,100
Klasse AU	59,094
Klasse AUP	63,640
Klasse DE	15.027,698
Klasse DEH	37.915,284
Klasse DU	1.069,760
Klasse IE	52,100
Klasse IEC	58,100
Klasse IEH	54,100
Klasse IFH	59,100
Klasse IG	17.930,113
Klasse IU	57,576
Klasse NE	23.087,450
Klasse NG	5.919.787,311
Klasse NU	1.911.462,394
Klasse XG	59,000
Klasse ZEH	54,100
Klasse ZFH	60,100
Klasse ZU	755,717

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		78.667.240
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.197.855
Zinsen aus Bankguthaben	2	3.932
Erträge, insgesamt		1.201.787
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(95.896)
Betriebskosten	3, 5	(93.195)
Aufwand, insgesamt		(189.091)
Nettoertrag aus Anlagen		1.012.696
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(853.228)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(12.348)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(16.572)
Realisierter Netto(verlust)		(882.148)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(2.431.410)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(2.840)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(2.434.250)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(2.303.702)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		77.312.949
Anteilrücknahmen		(26.568.342)
Dividenden	7	(31)
Kapitalbewegungen, insgesamt		50.744.576
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		127.108.114

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	127.108.114	78.667.240	26.554.871

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	17,3387 ¹	18,2898 ¹	15,2404 ¹
Klasse AEH	14,7127 ¹	16,4623 ¹	14,6709 ¹
Klasse AU	16,9147	18,2540	16,0663
Klasse AUP	15,0962	16,5908	14,8613
Klasse DE	17,1314 ¹	18,1073 ¹	15,1186 ¹
Klasse DEH	14,5482 ¹	16,3108 ¹	14,5633 ¹
Klasse DU	16,7021	18,0794	15,9450
Klasse IE	17,6533 ¹	18,5659 ¹	15,4165 ¹
Klasse IEC	13,3367 ¹	15,1809 ¹	13,7286 ¹
Klasse IEH	14,9688 ¹	16,7198 ¹	14,8479 ¹
Klasse IFH	14,7703 ²	16,5489 ²	14,7157 ²
Klasse IG	14,6434 ³	14,8037 ³	12,3891 ³
Klasse IU	17,2386	18,5671	16,2814
Klasse NE	14,2582 ¹	14,9581 ¹	12,3904 ¹
Klasse NG	13,7199 ³	13,8493 ³	11,5750 ³
Klasse NU	13,1041	14,0857	12,3331
Klasse XG	13,7984 ³	13,9108 ³	11,6147 ³
Klasse ZEH	14,9070 ¹	16,6597 ¹	14,8103 ¹
Klasse ZFH	14,6835 ²	16,4549 ²	14,6448 ²
Klasse ZU	17,1426	18,4729	16,2192

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

²Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

³Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	433.197.682
Bankguthaben	2	1.216.394
Forderungen aus Zeichnungen		184.892
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		629.632
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	24.948
Sonstige Aktiva		698.502
Aktiva, insgesamt		435.952.050
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(178.380)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(256.815)
Sonstige Passiva		(42.592)
Passiva, insgesamt		(477.787)
Nettovermögen, insgesamt		435.474.263

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	138.144,612
Klasse ASH	884.938,817
Klasse AUH	5.301,591
Klasse DE	143.717,026
Klasse IE	2.322.201,033
Klasse W	30.997,242
Klasse XE	1.343.634,723
Klasse ZE	646.420,857
Klasse ZUH	5.381,483
Klasse 1E	2.971.226,626
Klasse 1EP	65,000
Klasse 1G	160.738,427
Klasse 1GP	59,000
Klasse 2E	7.299.867,359
Klasse 2G	449.433,863
Klasse 2U	73,000
Klasse 3E	94.817,983
Klasse 3G	225.058,394
Klasse 3GP	382,218
Klasse 4E	416.408,472
Klasse 4G	55,000
Klasse 8E	215.710,164
Klasse 8G	36.280,399
Klasse 8U	73,000
Klasse 9E	62,000
Klasse 9G	56,000
Klasse 9GP	57,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		475.145.184
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	11.810.950
Zinsen aus Bankguthaben	2	8.009
Sonstige Erträge		308
Erträge, insgesamt		11.819.267
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(2.947.776)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(9.285)
Betriebskosten	3, 5	(528.243)
Aufwand, insgesamt		(3.485.304)
Nettoertrag aus Anlagen		8.333.963
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(3.342.840)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		274.019
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(150.000)
Realisierter Nettogewinn aus Steuerrückforderung		13
Realisierter Netto(verlust)		(3.218.808)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(5.743.050)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		38.773
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(5.704.277)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(589.122)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		89.195.389
Anteilrücknahmen		(128.276.955)
Dividenden	7	(233)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(39.081.799)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		435.474.263

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
EUR	435.474.263	475.145.184	386.572.137

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities**AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL**

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	83,5774	83,5781	78,4220
Klasse ASH	24,5969 ¹	24,0735 ¹	22,3960 ¹
Klasse AUH	29,8927 ²	28,9294 ²	26,8262 ²
Klasse DE	30,0559	30,1163	28,3149
Klasse IE	59,7803	59,3341	55,2576
Klasse W	69,9400	70,0340	65,8450
Klasse XE	70,2841	69,2730	64,0957
Klasse ZE	9,8833	9,8259	–
Klasse ZUH	19,6715 ²	18,9486 ²	17,4726 ²
Klasse 1E	13,3051	13,3070	12,4836
Klasse 1EP	12,3086	12,6891	12,2262
Klasse 1G	12,9932 ³	12,4978 ³	11,8186 ³
Klasse 1GP	12,0282 ³	11,9244 ³	11,5799 ³
Klasse 2E	13,6414	13,5821	12,6844
Klasse 2G	13,3206 ³	12,7552 ³	12,0079 ³
Klasse 2U	12,7149 ²	12,9544 ²	12,7712 ²
Klasse 3E	13,7277	13,6488	12,7289
Klasse 3G	13,4053 ³	12,8183 ³	12,0504 ³
Klasse 3GP	12,4223 ³	12,2439 ³	11,8079 ³
Klasse 4E	14,2809	14,0773	13,0161
Klasse 4G	13,9701 ³	13,2403 ³	12,3357 ³
Klasse 8E	13,6107	13,5570	12,6660
Klasse 8G	13,2969 ³	12,7375 ³	11,9961 ³
Klasse 8U	12,6872 ²	12,9310 ²	12,7491 ²
Klasse 9E	13,7945	13,7069	12,7770
Klasse 9G	13,4619 ³	12,8673 ³	12,0896 ³
Klasse 9GP	12,4892 ³	12,3004 ³	11,8602 ³

¹Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

²Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

³Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	68.880.135
Bankguthaben	2	295.155
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		296.086
Forderungen aus Zeichnungen		77.762
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		88.980
Sonstige Aktiva		282.411
Aktiva, insgesamt		69.920.529
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(297.591)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(80.199)
Verbindlichkeiten aus		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(47.463)
Sonstige Passiva		(8.533)
Passiva, insgesamt		(433.786)
Nettovermögen, insgesamt		69.486.743

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	754,188
Klasse AEP	38.312,313
Klasse AUP	80,000
Klasse DE	1.655,034
Klasse DEP	17.413,058
Klasse IE	1.179.227,428
Klasse IEP	653.490,000
Klasse ZE	65,000
Klasse ZEP	22.802,000
Klasse 1E	3.523.281,743
Klasse 1EP	10.397.992,113
Klasse 1G	170.467,092
Klasse 1GP	329.566,345
Klasse 2E	928.650,278
Klasse 2EP	72,000
Klasse 2G	58,000
Klasse 2GP	63,000
Klasse 3EP	71.251,006
Klasse 3G	71.165,838
Klasse 3GP	609.089,451
Klasse 4GP	7.350.534,040
Klasse 8E	252.431,001
Klasse 8EP	860.721,752
Klasse 8G	16.041,603
Klasse 8GP	478.750,358
Klasse 9EP	71,000
Klasse 9G	57,000
Klasse 9GP	263,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		60.925.035
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.269.392
Zinsen aus Bankguthaben	2	1.219
Sonstige Erträge		140
Erträge, insgesamt		2.270.751
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(505.592)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(3.127)
Betriebskosten	3, 5	(83.307)
Sonstige Gebühren	4	(16)
Aufwand, insgesamt		(592.042)
Nettoertrag aus Anlagen		1.678.709
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(1.648.741)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		4.295
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(47.310)
Realisierter Nettogewinn aus Steuerrückforderung		10
Realisierter Netto(verlust)		(1.691.746)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		1.600.038
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		1.600.038
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		1.587.001
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		19.534.285
Anteilrücknahmen		(11.142.711)
Dividenden	7	(1.416.867)
Kapitalbewegungen, insgesamt		6.974.707
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		69.486.743

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
EUR	69.486.743	60.925.035	72.471.914

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	12,6500	12,2899	12,2123
Klasse AEP	10,5858	10,7997	11,1512
Klasse AUP	10,4337 ¹	10,9127 ¹	11,9099 ¹
Klasse DE	12,4468	12,1356	12,1020
Klasse DEP	10,4095	10,6571	11,0429
Klasse IE	13,1920	12,6707	12,4632
Klasse IEP	11,0419	11,1344	11,3788
Klasse ZE	13,0688	12,6183	12,4458
Klasse ZEP	10,9401	11,0767	11,3507
Klasse 1E	2,0670	2,0062	1,9917
Klasse 1EP	1,0503	1,0714	1,1057
Klasse 1G	1,8160 ²	1,6952 ²	1,6964 ²
Klasse 1GP	0,9240 ²	0,9066 ²	0,9428 ²
Klasse 2E	13,0603	12,5994	12,4322
Klasse 2EP	10,9561	11,0904	11,3572
Klasse 2G	13,0785 ²	12,1240 ²	12,0502 ²
Klasse 2GP	10,9385 ²	10,6484 ²	10,9938 ²
Klasse 3EP	1,7311	1,7509	1,7928
Klasse 3G	1,7759 ²	1,6454 ²	1,6343 ²
Klasse 3GP	1,5112 ²	1,4708 ²	1,5182 ²
Klasse 4GP	1,3545 ²	1,3081 ²	1,3394 ²
Klasse 8E	2,2984	2,2182	2,1897
Klasse 8EP	1,1545	1,1693	1,1990
Klasse 8G	2,0212 ²	1,8760 ²	1,8667 ²
Klasse 8GP	1,0142 ²	0,9875 ²	1,0208 ²
Klasse 9EP	11,0341	11,1480	11,4256
Klasse 9G	13,1481 ²	12,1739 ²	12,0857 ²
Klasse 9GP	11,0089 ²	10,6983 ²	11,0352 ²

¹Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

²Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	389.364.672
Bankguthaben	2	1.777.342
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		96.560
Forderungen aus Zeichnungen		146.277
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		494.490
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	13.155
Sonstige Aktiva	20	698.593
Aktiva, insgesamt		392.591.089
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(292.531)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(455.822)
Sonstige Passiva		(108.173)
Passiva, insgesamt		(856.526)
Nettovermögen, insgesamt		391.734.563

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	4.719.667,977
Klasse ASH	374.732,185
Klasse AUH	11.283,289
Klasse DE	1.159.157,536
Klasse DUH	275,000
Klasse IE	1.679.106,647
Klasse W	9.912,171
Klasse XE	88,000
Klasse ZE	3.323.243,164
Klasse ZFH	5.601,004

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	43,8005	50,4135	53,6034
Klasse ASH	30,8067 ¹	34,6658 ¹	36,5279 ¹
Klasse AUH	12,0652 ²	13,4075 ²	14,0753 ²
Klasse DE	38,7886	45,0490	48,3327
Klasse DUH	11,5560 ²	12,9610 ²	13,7346 ²
Klasse IE	55,8653	63,8189	67,3496
Klasse W	73,1946	84,2877	89,6657
Klasse XE	9,2026	10,4050	–
Klasse ZE	11,2353	12,8349	13,5449
Klasse ZFH	10,7434 ³	12,3467 ³	13,0545 ³

¹Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.²Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.³Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		
Ertrag		673.597.948
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	8.465.934
Zinsen aus Bankguthaben	2	5.659
Sonstige Erträge		233
Erträge, insgesamt		8.471.826
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(6.053.423)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(11.620)
Betriebskosten	3, 5	(1.434.786)
Aufwand, insgesamt		(7.499.829)
Nettoertrag aus Anlagen		971.997
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(2.919.074)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		615.400
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		44.589
Realisierter Nettogewinn aus Steuerrückforderung		13
Realisierter Netto(verlust)		(2.259.072)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(84.725.377)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		37.711
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(84.687.666)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(85.974.741)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		48.474.706
Anteilrücknahmen		(244.363.350)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(195.888.644)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		391.734.563

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
EUR	391.734.563	673.597.948	967.772.792

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	743.105.034
Bankguthaben	2	2.558.722
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		189.075
Forderungen aus Zeichnungen		68.562
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		806.904
Sonstige Aktiva		1.831.816
Aktiva, insgesamt		748.560.113
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(972.164)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(396.052)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(630.516)
Sonstige Passiva		(93.898)
Passiva, insgesamt		(2.092.630)
Nettovermögen, insgesamt		746.467.483

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse IE	1.048.877,064
Klasse ZE	826.848,727
Klasse 1E	19.388.025,495
Klasse 1EP	675.169,392
Klasse 1FH	200.873,710
Klasse 1G	570.489,917
Klasse 1UH	1.517.719,944
Klasse 2E	15.340.003,969
Klasse 2G	56,000
Klasse 3E	11.816.237,955
Klasse 3EP	936.181,220
Klasse 3FH	638.906,591
Klasse 3G	1.848.743,337
Klasse 3GP	143.890,562
Klasse 3UH	749.173,342
Klasse 4E	1.785.471,465
Klasse 4G	1.832.020,560
Klasse 8E	3.611.191,677
Klasse 8G	483.570,549
Klasse 9E	5.836.490,672
Klasse 9EP	64,000
Klasse 9FH	23.354,059
Klasse 9G	924.438,277
Klasse 9GP	57,000
Klasse 9UH	98.344,006

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		1.236.395.974
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	17.313.945
Zinsen aus Bankguthaben	2	5.628
Sonstige Erträge		467
Erträge, insgesamt		17.320.040
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(8.397.660)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(14.605)
Betriebskosten	3, 5	(1.281.715)
Aufwand, insgesamt		(9.693.980)
Nettoertrag aus Anlagen		7.626.060
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(39.497.577)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		2.912.107
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		143.855
Realisierter Nettogewinn aus Steuerrückforderung		107
Realisierter Netto(verlust)		(36.441.508)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(105.230.833)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(104.432)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(105.335.265)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(134.150.713)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		53.526.211
Anteilrücknahmen		(408.967.070)
Dividenden	7	(336.919)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(355.777.778)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		746.467.483

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
EUR	746.467.483	1.236.395.974	1.980.272.935

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse IE	10,8544	12,1084	13,0732
Klasse ZE	10,5207	11,7537	12,7094
Klasse 1E	10,2286	11,4986	12,5109
Klasse 1EP	9,5356	10,9343	12,0777
Klasse 1FH	10,0750 ¹	11,3955 ¹	12,4182 ¹
Klasse 1G	9,9865 ²	10,7968 ²	11,8416 ²
Klasse 1UH	11,3113 ³	12,2785 ³	13,1915 ³
Klasse 2E	10,5360	11,7673	12,7202
Klasse 2G	10,2944 ²	11,0646 ²	12,0514 ²
Klasse 3E	10,6150	11,8366	12,7747
Klasse 3EP	9,9003	11,2596	12,3346
Klasse 3FH	10,4566 ¹	11,7317 ¹	12,6823 ¹
Klasse 3G	10,3626 ²	11,1130 ²	12,0901 ²
Klasse 3GP	9,6655 ²	10,5711 ²	11,6735 ²
Klasse 3UH	11,7341 ³	12,6338 ³	13,4644 ³
Klasse 4E	11,0319	12,1985	13,0550
Klasse 4G	12,0536 ²	12,8182 ²	13,8285 ²
Klasse 8E	10,5187	11,7527	12,7095
Klasse 8G	10,2696 ²	11,0354 ²	12,0297 ²
Klasse 9E	10,6358	11,8550	12,7895
Klasse 9EP	9,9388	11,2856	12,3547
Klasse 9FH	10,4765 ¹	11,7487 ¹	12,6978 ¹
Klasse 9G	10,3853 ²	11,1328 ²	12,1068 ²
Klasse 9GP	9,7133 ²	10,6036 ²	11,7010 ²
Klasse 9UH	11,7629 ³	12,6594 ³	13,4863 ³

¹Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

²Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

³Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

Threadneedle (Lux) - European Select

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.533.556.605
Bankguthaben	2	1.015.110
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		7.516.288
Forderungen aus Zeichnungen		92.605
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		237.239
Sonstige Aktiva	20	3.889.945
Aktiva, insgesamt		1.546.307.792
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(11.637.067)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(538.509)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(185.379)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.681.414)
Sonstige Passiva		(175.072)
Passiva, insgesamt		(14.217.441)
Nettovermögen, insgesamt		1.532.090.351

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	142.776,027
Klasse AGH	19.585,978
Klasse AUH	285.078,104
Klasse DUH	66,000
Klasse IE	515.704,670
Klasse ZE	85,000
Klasse ZG	15.240,197
Klasse ZGH	155.247,985
Klasse 1E	73.380.614,792
Klasse 1EP	915.057,483
Klasse 1SH	1.856.727,524
Klasse 1U	31.307,338
Klasse 1UH	1.009.285,750
Klasse 2E	7.091.555,326
Klasse 2EP	57,000
Klasse 3E	1.833.432,086
Klasse 3U	536.612,311
Klasse 8E	1.891.370,362
Klasse 8EP	26.200,536
Klasse 9E	12.361.174,682
Klasse 9U	63,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		1.623.386.971
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	21.675.137
Zinsen aus Bankguthaben	2	9.751
Sonstige Erträge		1.422
Erträge, insgesamt		21.686.310
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(18.786.796)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(17.533)
Betriebskosten	3, 5	(1.930.641)
Aufwand, insgesamt		(20.734.970)
Nettoertrag aus Anlagen		951.340
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		76.966.571
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.446.638
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		115.172
Realisierter Nettogewinn aus Steuerrückforderung		1
Realisierter Nettogewinn		78.528.382
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(59.880.932)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(81.852)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(59.962.784)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		19.516.938
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		190.992.480
Anteilrücknahmen		(301.605.547)
Dividenden	7	(200.491)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(110.813.558)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		1.532.090.351

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
EUR	1.532.090.351	1.623.386.971	1.641.460.241

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Select

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	30,7946	30,1120	29,4285
Klasse AGH	33,4259 ¹	32,2683 ¹	31,3771 ¹
Klasse AUH	36,1250 ²	34,1941 ²	33,0305 ²
Klasse DUH	15,0044 ²	14,2740 ²	13,8650 ²
Klasse IE	45,1332	43,7595	42,4042
Klasse ZE	9,3846	9,1184	–
Klasse ZG	15,6331 ¹	14,5919 ¹	14,2678 ¹
Klasse ZGH	34,7713 ¹	33,3203 ¹	32,1562 ¹
Klasse 1E	14,7181	14,3703	14,0231
Klasse 1EP	13,7522	13,6418	13,5040
Klasse 1SH	15,6546 ³	14,9506 ³	14,4595 ³
Klasse 1U	13,8087 ²	13,8075 ²	14,2325 ²
Klasse 1UH	16,1804 ²	15,2829 ²	14,7401 ²
Klasse 2E	15,1090	14,6652	14,2266
Klasse 2EP	14,1356	13,9345	13,7092
Klasse 3E	15,2310	14,7570	14,2900
Klasse 3U	14,2879 ²	14,1771 ²	14,5014 ²
Klasse 8E	15,0828	14,6457	14,2134
Klasse 8EP	14,1062	13,9187	13,7016
Klasse 9E	15,2571	14,7765	14,3031
Klasse 9U	14,3329 ²	14,2172 ²	14,5368 ²

¹Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

²Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

³Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.435.047.467
Bankguthaben	2	2.853.132
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		3.284.167
Forderungen aus Zeichnungen		109.450
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		2.475.954
Sonstige Aktiva	20	3.421.498
Aktiva, insgesamt		1.447.191.668
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(483.723)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(147.122)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.668.332)
Sonstige Passiva		(249.686)
Passiva, insgesamt		(2.548.863)
Nettovermögen, insgesamt		1.444.642.805

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse IE	853.471,477
Klasse ZE	725.351,743
Klasse 1E	88.762.917,241
Klasse 1EP	3.453.434,339
Klasse 1FH	61,000
Klasse 2E	1.593.232,507
Klasse 3E	4.869.874,696
Klasse 3EP	80.358,418
Klasse 3FH	778.300,982
Klasse 8E	4.705.646,739
Klasse 9E	4.769.673,471
Klasse 9EP	555.375,000
Klasse 9FH	221,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse IE	12,0030	12,6494	13,0435
Klasse ZE	13,3280	14,0668	14,5269
Klasse 1E	12,9677	13,7718	14,3106
Klasse 1EP	12,1305	13,1298	13,8388
Klasse 1FH	12,7811 ¹	13,6535 ¹	14,2143 ¹
Klasse 2E	13,3491	14,0850	14,5412
Klasse 3E	13,4001	14,1189	14,5559
Klasse 3EP	12,5586	13,4851	14,0994
Klasse 3FH	13,2238 ¹	14,0261 ¹	14,4944 ¹
Klasse 8E	13,3279	14,0682	14,5297
Klasse 9E	13,4533	14,1693	14,6020
Klasse 9EP	12,5916	13,5144	14,1156
Klasse 9FH	13,2294 ¹	14,0265 ¹	14,4918 ¹

¹Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		1.772.635.200
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	27.358.454
Zinsen aus Bankguthaben	2	951
Sonstige Erträge		5.535
Erträge, insgesamt		27.364.940
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(19.682.801)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(19.473)
Betriebskosten	3, 5	(2.944.646)
Aufwand, insgesamt		(22.646.920)
Nettoertrag aus Anlagen		4.718.020
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(2.509.703)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		418.151
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(26.340)
Realisierter Nettogewinn aus Steuerrückforderung		74
Realisierter Netto(verlust)		(2.117.818)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(119.144.798)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(235.205)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(119.380.003)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(116.779.801)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		135.397.266
Anteilrücknahmen		(345.680.393)
Dividenden	7	(929.467)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(211.212.594)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		1.444.642.805

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
EUR	1.444.642.805	1.772.635.200	1.932.987.086

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	51.275.240
Bankguthaben	2	372.820
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		103.729
Forderungen aus Zeichnungen		3.393
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		244.326
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	68.771
Sonstige Aktiva	20	631.332
Aktiva, insgesamt		52.699.611
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(377.585)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(29.699)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(34.682)
Sonstige Passiva		(9.336)
Passiva, insgesamt		(451.302)
Nettovermögen, insgesamt		52.248.309

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	32.759,019
Klasse AU	46.890,237
Klasse AUP	179.982,457
Klasse DEH	161.772,801
Klasse DU	44.129,797
Klasse DUP	27.505,940
Klasse IEP	1.063.069,353
Klasse IU	70,000
Klasse W	19.129,778
Klasse XU	1.307.720,471
Klasse XUP	269.785,749
Klasse ZG	51,000
Klasse ZGH	6.917,198
Klasse ZGP	56,000
Klasse ZU	100,000
Klasse ZUP	3.829,949

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AEH	38,9105 ¹	45,2875 ¹	49,6140 ¹
Klasse AU	101,8799	114,4216	123,7850
Klasse AUP	11,5123	13,4844	15,1272
Klasse DEH	27,2703 ¹	31,9765 ¹	35,2821 ¹
Klasse DU	48,8592	55,2874	60,2623
Klasse DUP	11,1252	13,1305	14,8423
Klasse IEP	12,3493 ¹	14,0025 ¹	14,7448 ¹
Klasse IU	11,8781	13,2161	14,1867
Klasse W	75,1452	84,5649	91,6683
Klasse XU	13,3803	14,7814	15,7291
Klasse XUP	12,2763	14,1419	15,6032
Klasse ZG	13,2498 ²	13,8913 ²	14,2390 ²
Klasse ZGH	22,6597 ²	25,8292 ²	27,9288 ²
Klasse ZGP	11,1818 ²	12,2208 ²	12,9909 ²
Klasse ZU	8,8505	9,8775	–
Klasse ZUP	13,5022	15,6966	17,4725

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		52.164.940
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.729.457
Zinsen aus Bankguthaben	2	19.994
Sonstige Erträge		80.154
Erträge, insgesamt		1.829.605
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(369.133)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(1.286)
Betriebskosten	3, 5	(103.429)
Sonstige Gebühren	4	(49)
Aufwand, insgesamt		(473.897)
Nettoertrag aus Anlagen		1.355.708
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(473.648)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(55.465)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(42.377)
Realisierter Netto(verlust)		(571.490)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(6.288.886)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		25.349
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(6.263.537)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(5.479.319)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		11.931.527
Anteilrücknahmen		(5.591.220)
Dividenden	7	(777.619)
Kapitalbewegungen, insgesamt		5.562.688
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		52.248.309

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	52.248.309	52.164.940	52.863.212

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	619.850.434
Bankguthaben	2	22.576.640
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.005.798
Forderungen aus Zeichnungen		715.198
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		219.813
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	824.792
Aktiva, insgesamt		645.192.675
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(638.341)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(432.015)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(723.544)
Sonstige Passiva		(141.167)
Passiva, insgesamt		(1.935.067)
Nettovermögen, insgesamt		643.257.608

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	628.244,882
Klasse AS	851.750,116
Klasse AU	3.117.132,234
Klasse AUP	72.094,859
Klasse BU	58.486,227
Klasse DEH	285.567,362
Klasse DU	553.054,756
Klasse IE	670.072,960
Klasse IEH	1.205.225,041
Klasse IG	17.898,636
Klasse IU	8.697.335,652
Klasse ZEH	108.502,011
Klasse ZFH	43.765,815
Klasse ZG	32.679,256
Klasse ZU	1.299.243,266

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AEH	62,5310 ¹	73,7380 ¹	67,4347 ¹
Klasse AS	22,3014 ²	25,6949 ²	23,0106 ²
Klasse AU	87,0049	98,4809	88,8329
Klasse AUP	18,4591	21,0644	19,1460
Klasse BU	109,3899	124,3152	112,5857
Klasse DEH	17,8847 ¹	21,1515 ¹	19,4109 ¹
Klasse DU	127,1439	144,4193	130,7275
Klasse IE	15,8873 ¹	17,4019 ¹	14,7271 ¹
Klasse IEH	21,4521 ¹	25,0771 ¹	22,7318 ¹
Klasse IG	22,0881 ³	23,2680 ³	19,8499 ³
Klasse IU	15,5489	17,4419	15,5922
Klasse ZEH	17,7747 ¹	20,7904 ¹	18,8611 ¹
Klasse ZFH	20,7055 ⁴	24,2713 ⁴	22,0485 ⁴
Klasse ZG	22,0003 ³	23,1988 ³	19,8092 ³
Klasse ZU	40,1267	45,0572	40,3192

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁴Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		651.663.253
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	3.583.118
Zinsen aus Bankguthaben	2	255.996
Erträge, insgesamt		3.839.114
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(8.210.961)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(8.490)
Betriebskosten	3, 5	(1.589.629)
Aufwand, insgesamt		(9.809.080)
Netto(verlust) aus Anlagen		(5.969.966)
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(6.152.374)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(5.096.904)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(131.195)
Realisierter Netto(verlust)		(11.380.473)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(60.229.179)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(142.190)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(60.371.369)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(77.721.808)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		259.575.699
Anteilrücknahmen		(190.249.085)
Dividenden		(10.451)
Kapitalbewegungen, insgesamt		69.316.163
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		643.257.608

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	643.257.608	651.663.253	537.276.170

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - UK Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 GBP
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	165.486.673
Bankguthaben	2	1.382.334
Forderungen aus Zeichnungen		350.176
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		520.056
Sonstige Aktiva		126
Aktiva, insgesamt		167.739.365
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(187.176)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(117.886)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(105.549)
Sonstige Passiva		(27.333)
Passiva, insgesamt		(437.944)
Nettovermögen, insgesamt		167.301.421

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	98.316,766
Klasse AEH	116.093,974
Klasse AFH	7.192,000
Klasse AG	390.355,107
Klasse AGP	29.929,121
Klasse DEH	8.344,846
Klasse DG	75.395,788
Klasse IE	562.634,940
Klasse IEH	163.459,547
Klasse IG	2.307.719,116
Klasse IGP	221.925,062
Klasse NEH	66,000
Klasse NFH	73,000
Klasse NG	57,000
Klasse NGP	57,000
Klasse NUH	78,000
Klasse TEH	66,000
Klasse TFH	73,000
Klasse TG	57,000
Klasse TGP	57,000
Klasse TUH	78,000
Klasse ZE	20.941,383
Klasse ZEH	74.052,824
Klasse ZFH	3.325,000
Klasse ZG	147.037,906
Klasse ZGP	116.311,257
Klasse ZUH	57.569,000
Klasse 3EH	1.174.832,427
Klasse 3FH	49.785,040
Klasse 3UH	1.805.391,582
Klasse 9EH	9.707,339
Klasse 9EP	2.589.832,979
Klasse 9FH	85,000
Klasse 9G	11.018,300
Klasse 9UH	87,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 GBP
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		274.453.238
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	6.780.540
Zinsen aus Bankguthaben	2	20.563
Erträge, insgesamt		6.801.103
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.706.828)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(1.991)
Betriebskosten	3, 5	(387.992)
Aufwand, insgesamt		(2.096.811)
Nettoertrag aus Anlagen		4.704.292
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(15.237.103)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		812.976
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(46.033)
Realisierter Netto(verlust)		(14.470.160)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		5.339.132
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(81.045)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		5.258.087
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(4.507.781)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		99.336.984
Anteilrücknahmen		(200.652.322)
Dividenden	7	(1.328.698)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(102.644.036)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		167.301.421

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
GBP	167.301.421	274.453.238	296.943.244

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - UK Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	9,4273 ¹	9,3165 ¹	9,2845 ¹
Klasse AEH	20,6050 ¹	19,9122 ¹	20,1489 ¹
Klasse AFH	9,9885 ²	9,7085 ²	9,8231 ²
Klasse AG	29,3049	27,8526	27,9800
Klasse AGP	20,7157	20,3018	21,0118
Klasse DEH	9,6352 ¹	9,3874 ¹	9,5731 ¹
Klasse DG	10,1533	9,7276	9,8507
Klasse IE	10,1864 ¹	9,9716 ¹	9,8435 ¹
Klasse IEH	31,4994 ¹	30,1611 ¹	30,2322 ¹
Klasse IG	43,2514	40,7193	40,5187
Klasse IGP	30,8986	29,9926	30,7471
Klasse NEH	12,9677 ¹	12,3773 ¹	12,3770 ¹
Klasse NFH	12,8955 ²	12,3772 ²	12,3746 ²
Klasse NG	13,3079	12,5034	12,4164
Klasse NGP	12,4219	12,0225	12,2963
Klasse NUH	13,6193 ³	12,6056 ³	12,4477 ³
Klasse TEH	12,9563 ¹	12,3724 ¹	12,3766 ¹
Klasse TFH	12,8835 ²	12,3703 ²	12,3738 ²
Klasse TG	13,3116	12,5042	12,4163
Klasse TGP	12,4067	12,0170	12,2962
Klasse TUH	13,6152 ³	12,6005 ³	12,4472 ³
Klasse ZE	9,6466 ¹	9,4643 ¹	9,3628 ¹
Klasse ZEH	12,8699 ¹	12,3480 ¹	12,4008 ¹
Klasse ZFH	12,4052 ²	11,9648 ²	12,0143 ²
Klasse ZG	28,6161	26,9947	26,9156
Klasse ZGP	11,0805	10,7776	11,0735
Klasse ZUH	11,8096 ³	10,9752 ³	10,8824 ³
Klasse 3EH	1,8386 ¹	1,7608 ¹	1,7651 ¹
Klasse 3FH	1,9650 ²	1,8918 ²	1,8962 ²
Klasse 3UH	2,3556 ³	2,1863 ³	2,1639 ³
Klasse 9EH	11,0302 ¹	10,5479 ¹	10,5716 ¹
Klasse 9EP	9,8665 ¹	9,9562 ¹	10,1260 ¹
Klasse 9FH	10,9400 ²	10,5292 ²	10,5498 ²
Klasse 9G	10,7349	10,1044	10,0527
Klasse 9UH	12,1115 ³	11,2422 ³	11,1280 ³

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

²Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

³Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 GBP
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	239.899.491
Bankguthaben	2	1.042.358
Forderungen aus Zeichnungen		189.641
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		927.338
Aktiva, insgesamt		242.058.828
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(209.723)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(737.507)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(127.950)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(141.357)
Sonstige Passiva		(43.098)
Passiva, insgesamt		(1.259.635)
Nettovermögen, insgesamt		240.799.193

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	1.692.515,605
Klasse AEC	45.167,097
Klasse AEH	118.996,596
Klasse AG	507.167,095
Klasse ASC	133,600
Klasse AUC	129.896,783
Klasse DE	2.654,203
Klasse DEC	12.739,967
Klasse DEH	4.780,573
Klasse DG	23.717,766
Klasse DGP	808,187
Klasse IE	1.985.401,134
Klasse IEH	20.378,034
Klasse IG	200.830,035
Klasse IGP	1.607.327,543
Klasse IU	645.313,204
Klasse IUH	80,000
Klasse LG	503.455,553
Klasse LGP	12.015.847,668
Klasse ZE	16.844,763
Klasse ZEH	31.152,710
Klasse ZFH	10.046,000
Klasse ZG	157.217,621
Klasse ZGP	97.189,252
Klasse ZUH	66.622,758
Klasse 1EH	161.165,641
Klasse 1FH	6.518,663
Klasse 1UH	80.815,007
Klasse 3EH	125.905,573
Klasse 3FH	50.377,689
Klasse 3UH	210.691,347
Klasse 9EH	73,000
Klasse 9FH	81,000
Klasse 9G	1.162.234,374
Klasse 9UH	2.174,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 GBP
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		232.631.300
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	9.071.984
Zinsen aus Bankguthaben	2	17.828
Erträge, insgesamt		9.089.812
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.732.551)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(2.409)
Betriebskosten	3, 5	(508.689)
Aufwand, insgesamt		(2.243.649)
Nettoertrag aus Anlagen		6.846.163
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		5.749.225
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.098.425
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		92.075
Realisierter Nettogewinn		6.939.725
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(1.354.375)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(36.239)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(1.390.614)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		12.395.274
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		98.670.788
Anteilrücknahmen		(97.388.592)
Dividenden	7	(5.509.577)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(4.227.381)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		240.799.193

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
GBP	240.799.193	232.631.300	203.529.182

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	12,6013 ¹	12,6812 ¹	11,6608 ¹
Klasse AEC	9,4634 ¹	9,6686 ¹	9,3261 ¹
Klasse AEH	11,7767 ¹	11,5877 ¹	10,8296 ¹
Klasse AG	12,5901	12,1852	11,2947
Klasse ASC	10,1010 ²	10,1013 ²	9,6533 ²
Klasse AUC	10,7034 ³	10,6068 ³	10,1151 ³
Klasse DE	12,0054 ¹	12,1725 ¹	11,2772 ¹
Klasse DEC	8,9702 ¹	9,2267 ¹	8,9790 ¹
Klasse DEH	11,2144 ¹	11,1182 ¹	10,4678 ¹
Klasse DG	11,9968	11,6992	10,9259
Klasse DGP	9,9693	10,0965	9,7473
Klasse IE	13,3960 ¹	13,3535 ¹	12,1630 ¹
Klasse IEH	12,5067 ¹	12,1998 ¹	11,2958 ¹
Klasse IG	13,4114	12,8573	11,8052
Klasse IGP	10,7517	10,7015	10,1383
Klasse IU	12,9928 ³	13,2640 ³	12,7617 ³
Klasse IUH	13,7584 ³	13,0077 ³	11,8874 ³
Klasse LG	13,5361	12,9575	11,8792
Klasse LGP	10,8271	10,7649	10,1870
Klasse ZE	13,2311 ¹	13,2156 ¹	12,0615 ¹
Klasse ZEH	12,3577 ¹	12,0729 ¹	11,2040 ¹
Klasse ZFH	12,1009 ⁴	11,8925 ⁴	11,0386 ⁴
Klasse ZG	13,2275	12,7064	11,6899
Klasse ZGP	11,1391	11,1107	10,5523
Klasse ZUH	14,0566 ³	13,3271 ³	12,2225 ³
Klasse 1EH	11,6827 ¹	11,4780 ¹	10,7111 ¹
Klasse 1FH	11,5429 ⁴	11,4101 ⁴	10,6537 ⁴
Klasse 1UH	12,8308 ³	12,2298 ³	11,2829 ³
Klasse 3EH	12,0836 ¹	11,7863 ¹	10,9193 ¹
Klasse 3FH	11,9357 ⁴	11,7136 ⁴	10,8540 ⁴
Klasse 3UH	13,2761 ³	12,5625 ³	11,5019 ³
Klasse 9EH	12,1085 ¹	11,7980 ¹	10,9227 ¹
Klasse 9FH	11,9323 ⁴	11,7077 ⁴	10,8516 ⁴
Klasse 9G	11,9888	11,4924	10,5508
Klasse 9UH	13,2859 ³	12,5653 ³	11,4992 ³

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

²Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

³Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

⁴Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	23. Januar 2023*	31. März 2022	31. März 2021
Klasse IU	3,6523	3,8464	3,8047
Klasse ZU	3,6528	3,8469	3,8053

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG
DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2022 bis 23. Januar 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		1.580.155
Ertrag		
Zinsen aus Bankguthaben	2	12.680
Erträge, insgesamt		12.680
Aufwand		
Betriebskosten	3, 5	(4.398)
Aufwand, insgesamt		(4.398)
Nettoertrag aus Anlagen		8.282
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(2.396)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(465)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(85.174)
Realisierter Netto(verlust)		(88.035)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(79.753)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		–
Anteilrücknahmen		(1.500.402)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(1.500.402)
Nettovermögen am Ende des Zeitraums		–

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	23. Januar 2023*	31. März 2022	31. März 2021
USD	–	1.580.155	6.857.182

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	18.848.174
Bankguthaben	2	2.441.307
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		473.673
Forderungen aus Zeichnungen		270
Zinsforderungen aus Swaps	2	12.095
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		15.834
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	187.055
Sonstige Aktiva		6.087
Aktiva, insgesamt		21.984.495
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(1.393.646)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(28.030)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(31.031)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(263.301)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten	2, 11	(613.670)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(13.589)
Sonstige Passiva		(3.824)
Passiva, insgesamt		(2.347.091)
Nettovermögen, insgesamt		19.637.404

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	28.063,946
Klasse AFH	764,000
Klasse AGH	599,522
Klasse AU	134.199,089
Klasse DEH	7.908,621
Klasse DU	337.015,020
Klasse IEH	108.431,798
Klasse IGH	26.698,188
Klasse IU	67.144,306
Klasse XGH	548.081,680
Klasse ZE	80,000
Klasse ZEH	83,000
Klasse ZGH	1.774,835
Klasse ZU	100,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AEH	14,8309 ¹	15,5801 ¹	15,3714 ¹
Klasse AFH	13,3909 ²	14,1612 ²	13,9949 ²
Klasse AGH	16,1906 ³	16,7573 ³	16,4018 ³
Klasse AU	17,2876	17,6966	17,2872
Klasse DEH	11,3655 ¹	12,0140 ¹	11,9135 ¹
Klasse DU	13,1644	13,5433	13,2965
Klasse IEH	21,8492 ¹	22,7694 ¹	22,2720 ¹
Klasse IGH	23,6037 ³	24,2352 ³	23,5814 ³
Klasse IU	25,1613	25,5384	24,8005
Klasse XGH	10,6525 ³	10,8426 ³	10,4372 ³
Klasse ZE	11,1038 ¹	11,0174 ¹	10,1161 ¹
Klasse ZEH	9,4994 ¹	9,9289 ¹	9,7263 ¹
Klasse ZGH	16,1995 ³	16,6367 ³	16,1525 ³
Klasse ZU	10,4522	10,6198	10,3329

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		24.741.485
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	211.641
Zinsen aus Bankguthaben	2	38.266
Zinsen aus Swaps		220.970
Zinsen aus Terminkontrakten		12.507
Erträge, insgesamt		483.384
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(146.935)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(3.916)
Dividendenaufwand aus Swaps		(139.152)
Zinsaufwand aus Swaps		(144.900)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(54)
Betriebskosten	3, 5	(49.932)
Aufwand, insgesamt		(484.889)
Netto(verlust) aus Anlagen		(1.505)
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(2.052.470)
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		1.400.931
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(1.659.989)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		1.027.747
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(100.569)
Realisierter Netto(verlust)		(1.384.350)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(799.637)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(122.677)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(31.567)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Terminkontrakten		280.990
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(672.891)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(2.058.746)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		28.670.689
Anteilrücknahmen		(31.716.024)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(3.045.335)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		19.637.404

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	19.637.404	24.741.485	103.961.830

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	405.167.576
Bankguthaben	2	33.693.370
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.810.282
Forderungen aus Zeichnungen		1.157.718
Zinsforderungen aus Swaps	2	270.548
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		5.247.913
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	507.363
Aktiva, insgesamt		447.854.770
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.117.098)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(4.113.526)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(589.206)
Eingegangene Vorauszahlung aus Swaps	2	(51.210)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(4.837.958)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten	2, 11	(5.585.899)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(233.866)
Sonstige Passiva		(38.490)
Passiva, insgesamt		(16.567.253)
Nettovermögen, insgesamt		431.287.517

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	1.141,754
Klasse IE	85,000
Klasse ZE	88.337,141
Klasse 1E	9.677.406,820
Klasse 1EP	53.679,268
Klasse 1GH	150.695,633
Klasse 1UH	184.976,506
Klasse 2E	19.766.231,059
Klasse 2EP	15.324,613
Klasse 2GC	76,000
Klasse 2GH	7.383,713
Klasse 4GH	165.803,293
Klasse 8E	13.992.640,928
Klasse 8EP	124.630,995
Klasse 8GC	1.303,020
Klasse 8GH	433.241,882

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		980.879.073
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	62.755
Zinsen aus Anleihen, netto	2	24.441.473
Zinsen aus Bankguthaben	2	30.214
Zinsen aus Swaps		5.069.943
Zinsen aus Terminkontrakten		390.856
Sonstige Erträge		335
Erträge, insgesamt		29.995.576
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(3.853.369)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(242.494)
Zinsaufwand aus Swaps		(17.791.392)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(233.172)
Betriebskosten	3, 5	(606.322)
Sonstige Gebühren	4	(32)
Aufwand, insgesamt		(22.726.781)
Nettoertrag aus Anlagen		7.268.795
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(54.999.381)
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		240.798
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(3.739.435)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		59.247.729
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(825.968)
Realisierter Netto(verlust)		(76.257)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(25.387.502)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		15.010.568
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(4.000.444)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Terminkontrakten		(22.180.450)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(36.557.828)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(29.365.290)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		115.900.966
Anteilrücknahmen		(635.953.718)
Dividenden	7	(173.514)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(520.226.266)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		431.287.517

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
EUR	431.287.517	980.879.073	1.105.181.704

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	9,2862	9,7720	–
Klasse IE	9,3680	9,8024	–
Klasse ZE	9,5447	9,9967	10,2122
Klasse 1E	9,3721	9,8622	10,1181
Klasse 1EP	7,9045	8,7147	9,2533
Klasse 1GH	9,7939 ¹	10,1307 ¹	10,3276 ¹
Klasse 1UH	10,1457 ²	10,4460 ²	10,6393 ²
Klasse 2E	9,6387	10,0810	10,2797
Klasse 2EP	8,1165	8,8919	9,3705
Klasse 2GC	8,4780 ¹	9,1211 ¹	9,5453 ¹
Klasse 2GH	10,0735 ¹	10,3563 ¹	10,4925 ¹
Klasse 4GH	10,3070 ¹	10,5443 ¹	10,6305 ¹
Klasse 8E	9,6172	10,0626	10,2650
Klasse 8EP	8,1203	8,8993	9,3952
Klasse 8GC	8,4801 ¹	9,1415 ¹	9,5801 ¹
Klasse 8GH	10,0599 ¹	10,3438 ¹	10,4843 ¹

¹Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

²Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	16.460.178
Bankguthaben	2	1.521.050
Zinsforderungen aus Swaps	2	7.923
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		165.418
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	79.781
Sonstige Aktiva		5.767
Aktiva, insgesamt		18.240.117
Passiva		
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(17.097)
Eingegangene Vorauszahlung aus Swaps	2	(1.722)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(51.507)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten	2, 11	(284.885)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.517)
Sonstige Passiva		(1.739)
Passiva, insgesamt		(358.467)
Nettovermögen, insgesamt		17.881.650

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	20.319,717
Klasse AFH	92,200
Klasse AKH	84,000
Klasse ANH	830,000
Klasse AUH	572,957
Klasse DE	17.592,059
Klasse IE	373.561,836
Klasse IEP	89,999
Klasse IGH	67,800
Klasse INH	826,000
Klasse IU	92,000
Klasse IUH	90,000
Klasse JE	80,997
Klasse JGH	67,800
Klasse JUH	91,000
Klasse LE	9.581,001
Klasse LEP	89,000
Klasse LGH	67,800
Klasse XE	3.298,170
Klasse XGH	1.211.045,797
Klasse XUH	92,000
Klasse YE	82,001
Klasse YGH	68,800
Klasse YUH	91,000
Klasse ZE	81,997
Klasse ZFH	90,200
Klasse ZGH	67,800
Klasse ZUH	91,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		44.628.404
Ertrag		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	876.866
Zinsen aus Bankguthaben	2	9.466
Zinsen aus Swaps		238.028
Zinsen aus Terminkontrakten		34.904
Sonstige Erträge		2
Erträge, insgesamt		1.159.266
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(13.515)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(13.140)
Zinsaufwand aus Swaps		(670.289)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(24.740)
Betriebskosten	3, 5	(37.233)
Sonstige Gebühren	4	(15)
Aufwand, insgesamt		(758.932)
Nettoertrag aus Anlagen		400.334
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(4.007.497)
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		219.915
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(1.605.494)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		3.542.882
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		294.877
Realisierter Netto(verlust)		(1.555.317)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(75.423)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		342.495
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		102.049
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Terminkontrakten		(1.315.904)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(946.783)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(2.101.766)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		4.326.430
Anteilrücknahmen		(28.971.361)
Dividenden	7	(57)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(24.644.988)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		17.881.650

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
EUR	17.881.650	44.628.404	53.361.804

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	9,3843	9,9429	10,2349
Klasse AFH	9,1791 ¹	9,8101 ¹	10,1268 ¹
Klasse AKH	94,5085 ²	99,6323 ²	102,3358 ²
Klasse ANH	9,7009 ³	10,1446 ³	10,3661 ³
Klasse AUH	10,2804 ⁴	10,6635 ⁴	10,8977 ⁴
Klasse DE	9,1244	9,7208	10,0608
Klasse IE	9,6940	10,2044	10,4353
Klasse IEP	8,2812	9,0524	9,4983
Klasse IGH	10,1721 ⁵	10,5320 ⁵	10,6920 ⁵
Klasse INH	9,8776 ³	10,2572 ³	10,4013 ³
Klasse IU	9,3333 ⁴	10,0660 ⁴	10,8726 ⁴
Klasse IUH	10,5992 ⁴	10,9297 ⁴	11,0910 ⁴
Klasse JE	9,6769	10,1884	10,4159
Klasse JGH	10,1878 ⁵	10,5456 ⁵	10,6939 ⁵
Klasse JUH	10,5575 ⁴	10,8783 ⁴	11,0321 ⁴
Klasse LE	9,7648	10,2635	10,4800
Klasse LEP	8,4066	9,1580	9,5877
Klasse LGH	10,2762 ⁵	10,6048 ⁵	10,7382 ⁵
Klasse XE	10,0968	10,5895	10,7859
Klasse XGH	9,9837 ⁵	10,2913 ⁵	10,4148 ⁵
Klasse XUH	10,4837 ⁴	10,7628 ⁴	10,8737 ⁴
Klasse YE	9,6238	10,1443	10,3910
Klasse YGH	10,1032 ⁵	10,4650 ⁵	10,6432 ⁵
Klasse YUH	10,4761 ⁴	10,8066 ⁴	10,9872 ⁴
Klasse ZE	9,5978	10,1272	10,3835
Klasse ZFH	9,3880 ¹	9,9880 ¹	10,2620 ¹
Klasse ZGH	10,1022 ⁵	10,4758 ⁵	10,6642 ⁵
Klasse ZUH	10,5291 ⁴	10,8614 ⁴	11,0490 ⁴

¹Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

²Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

³Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

⁴Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

⁵Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	75.567.235
Bankguthaben	2	4.164.050
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		584.521
Forderungen aus Zeichnungen		197
Zinsforderungen aus Swaps	2	2.308.535
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		52.014
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	47.139
Sonstige Aktiva		230.192
Aktiva, insgesamt		82.953.883
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(1.581.523)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(1.183.975)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(255.219)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(1.748.411)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(79.651)
Sonstige Passiva		(19.189)
Passiva, insgesamt		(4.867.968)
Nettovermögen, insgesamt		78.085.915

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	1.591.069,034
Klasse AEP	28.481,437
Klasse AUH	77,000
Klasse DE	2.051.414,732
Klasse IE	892.897,803
Klasse IGH	13.209,827
Klasse LE	1.044.554,591
Klasse XGH	377.248,938
Klasse ZE	144.712,555
Klasse ZF	76,000
Klasse ZFH	77,000
Klasse ZGH	57,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	12,3069	12,1389	11,9823
Klasse AEP	12,3610	12,3867	12,3580
Klasse AUH	13,7357 ¹	13,1642 ¹	12,8933 ¹
Klasse DE	11,8833	11,7798	11,7839
Klasse IE	12,9068	12,6164	12,5007
Klasse IGH	13,4607 ²	12,9699 ²	12,7513 ²
Klasse LE	13,1617	12,8174	12,6752
Klasse XGH	14,9610 ²	14,3002 ²	13,8662 ²
Klasse ZE	12,9456	12,6671	12,5092
Klasse ZF	11,4147 ³	11,5379 ³	12,2367 ³
Klasse ZFH	12,0814 ³	11,9019 ³	11,8267 ³
Klasse ZGH	13,5842 ²	13,1142 ²	12,7204 ²

¹Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.²Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.³Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		123.839.076
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.511.785
Zinsen aus Bankguthaben	2	10.530
Zinsen aus Swaps		447.056
Sonstige Erträge		166
Erträge, insgesamt		2.969.537
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.069.086)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(11.172)
Dividendenaufwand aus Swaps		(1.598.311)
Zinsaufwand aus Swaps		(405.869)
Betriebskosten	3, 5	(264.971)
Aufwand, insgesamt		(3.349.409)
Netto(verlust) aus Anlagen		(379.872)
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(1.742.027)
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		729.073
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(336.440)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		39.653
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(36.291)
Realisierter Nettogewinn aus Steuerrückforderung		20
Realisierter Netto(verlust)		(1.346.012)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		3.181.145
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(1.701.408)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		46.192
Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn		1.525.929
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(199.955)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		8.746.159
Anteilrücknahmen		(54.293.849)
Dividenden	7	(5.516)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(45.553.206)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		78.085.915

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
EUR	78.085.915	123.839.076	235.387.755

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	87.795.769
Bankguthaben	2	1.783.847
Forderungen aus Zeichnungen		18.109
Zinsforderungen aus Swaps	2	14.721
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		76.770
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	21.617
Aktiva, insgesamt		89.710.833
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(52.820)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(43.535)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(83.311)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(570.509)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(77.684)
Sonstige Passiva		(12.005)
Passiva, insgesamt		(839.864)
Nettovermögen, insgesamt		88.870.969

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	977,889
Klasse AU	1.892,784
Klasse DEH	343,599
Klasse DU	21.360,497
Klasse IU	221.932,376
Klasse ZU	57,000
Klasse 1E	3.140.918,553
Klasse 1EH	368.566,336
Klasse 1U	1.122.973,971
Klasse 2E	2.804,467
Klasse 2U	186,000
Klasse 3U	45.196,000
Klasse 8E	295.471,699
Klasse 8U	1.324.966,558
Klasse 9U	2.334.763,880

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AEH	13,5117 ¹	16,4272 ¹	14,7944 ¹
Klasse AU	14,8565	17,4066	15,4832
Klasse DEH	13,2239 ¹	16,1610 ¹	14,6365 ¹
Klasse DU	14,5400	17,1211	15,3058
Klasse IU	15,4273	17,9132	15,7911
Klasse ZU	15,3226	17,8411	15,7432
Klasse 1E	7,1058 ¹	8,1204 ¹	6,8306 ¹
Klasse 1EH	4,9237 ¹	5,9805 ¹	5,3803 ¹
Klasse 1U	7,7187	9,0336	8,0266
Klasse 2E	16,2312 ¹	18,3931 ¹	15,3339 ¹
Klasse 2U	15,4950	17,9863	15,8326
Klasse 3U	4,3987	5,1096	4,5061
Klasse 8E	7,9140 ¹	8,9701 ¹	7,4837 ¹
Klasse 8U	8,5451	9,9191	8,7414
Klasse 9U	15,4564	17,9452	15,8025

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.**ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS**

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		125.198.445
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	867.205
Zinsen aus Bankguthaben	2	56.579
Zinsen aus Swaps		617.072
Erträge, insgesamt		1.540.856
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.186.291)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(2.845)
Dividendenaufwand aus Swaps		(189.375)
Zinsaufwand aus Swaps		(818.868)
Betriebskosten	3, 5	(163.437)
Aufwand, insgesamt		(2.360.816)
Netto(verlust) aus Anlagen		(819.960)
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(7.865.121)
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		1.255.583
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(133.731)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(22)
Realisierter Netto(verlust)		(6.743.291)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(10.789.450)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(40.473)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(3.840)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(10.833.763)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(18.397.014)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		44.296.113
Anteilrücknahmen		(62.226.575)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(17.930.462)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		88.870.969

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	88.870.969	125.198.445	112.622.890

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	73.822.965
Bankguthaben	2	2.184.180
Termineinlagen	2, 19	4.915.320
Forderungen aus Zeichnungen		910
Zinsforderungen aus Swaps	2	236.043
Dividendenforderungen aus Swaps		206.059
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		118.389
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	1.694
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2, 10	853.780
Sonstige Aktiva	20	60.049
Aktiva, insgesamt		82.399.389
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(872.576)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(294)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(436.682)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(97.327)
Sonstige Passiva		(12.478)
Passiva, insgesamt		(1.419.357)
Nettovermögen, insgesamt		80.980.032

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	52,000
Klasse AU	19.215,185
Klasse DEH	12.023,296
Klasse DU	618,597
Klasse IU	94.720,000
Klasse ZU	58,000
Klasse 1E	14.092.034,832
Klasse 1U	852.580,848
Klasse 2E	52,000
Klasse 2U	517,284
Klasse 8E	313.153,819
Klasse 8U	177.502,303

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AEH	12,3134 ¹	14,5886 ¹	15,0223 ¹
Klasse AU	13,5426	15,4367	15,6740
Klasse DEH	12,1476 ¹	14,4782 ¹	14,9762 ¹
Klasse DU	13,3338	15,2753	15,5884
Klasse IU	14,2037	16,0451	16,1456
Klasse ZU	14,0143	15,8776	15,9900
Klasse 1E	4,7036 ¹	5,2295 ¹	5,0213 ¹
Klasse 1U	5,1181	5,8275	5,9106
Klasse 2E	14,7996 ¹	16,3297 ¹	15,5305 ¹
Klasse 2U	14,1217	15,9419	16,0307
Klasse 8E	5,2661 ¹	5,8070 ¹	5,5302 ¹
Klasse 8U	5,7939	6,5431	6,5821

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		99.127.304
Ertrag		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	912.758
Zinsen aus Bankguthaben	2	215.605
Dividendenerträge aus Swaps		700
Zinsen aus Swaps		401.410
Erträge, insgesamt		1.530.473
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.197.855)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(6.624)
Zinsaufwand aus Swaps		(940.114)
Betriebskosten	3, 5	(154.011)
Aufwand, insgesamt		(2.298.604)
Netto(verlust) aus Anlagen		(768.131)
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(3.376.590)
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		455.385
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(46.571)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(70.125)
Realisierter Netto(verlust)		(3.037.901)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(7.302.213)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(1.011.932)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(12.645)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(8.326.790)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(12.132.822)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		5.708.287
Anteilrücknahmen		(11.722.737)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(6.014.450)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		80.980.032

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	80.980.032	99.127.304	209.555.266

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	187.368.122
Bankguthaben	2	4.981.820
Zinsforderungen aus Swaps	2	4.030.635
Forderungen aus Zeichnungen		7.821
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		27.935
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	1.107.623
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2, 10	2.142.039
Aktiva, insgesamt		199.665.995
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(115.274)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(2.953)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(72.655)
Sonstige Passiva		(19.579)
Passiva, insgesamt		(210.461)
Nettovermögen, insgesamt		199.455.534

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	277.991,211
Klasse AFH	225.781,729
Klasse AGH	72.671,597
Klasse ASH	725.225,281
Klasse AU	753.136,039
Klasse DEH	205.173,512
Klasse DU	397.240,047
Klasse IEH	364.809,006
Klasse IG	64,000
Klasse IGH	2.688.419,609
Klasse IU	347.435,513
Klasse NG	22.574,043
Klasse XU	4.793.550,062
Klasse ZEH	24.307,319
Klasse ZFH	160,000
Klasse ZGH	237.629,581
Klasse ZU	106.450,500

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2023

	Erläuterungen	2023 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		547.084.733
Ertrag		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	6.279.369
Zinsen aus Bankguthaben	2	457.874
Zinsen aus Swaps		61.628
Erträge, insgesamt		6.798.871
Aufwand		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.178.446)
Zinsen aus Bankguthaben	2	(17.307)
Zinsaufwand aus Swaps		(747.896)
Betriebskosten	3, 5	(512.069)
Sonstige Gebühren	4	(1.194)
Aufwand, insgesamt		(2.456.912)
Nettoertrag aus Anlagen		4.341.959
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		496.955
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(24.565.363)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(7.805.231)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(587.061)
Realisierter Netto(verlust)		(32.460.700)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		346.974
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(15.715.092)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(99.296)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)		(15.467.414)
Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(43.586.155)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		104.380.461
Anteilrücknahmen		(408.423.505)
Kapitalbewegungen, insgesamt		(304.043.044)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		199.455.534

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
USD	199.455.534	547.084.733	528.893.598

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2023	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AEH	10,6456 ¹	12,2529 ¹	8,4906 ¹
Klasse AFH	7,7799 ²	9,0157 ²	6,2739 ²
Klasse AGH	11,5943 ³	13,1736 ³	9,0951 ³
Klasse ASH	6,1489 ⁴	6,9266 ⁴	4,7702 ⁴
Klasse AU	13,0569	14,5604	10,0129
Klasse DEH	8,0276 ¹	9,2625 ¹	6,4457 ¹
Klasse DU	9,8496	11,0114	7,6039
Klasse IEH	15,8324 ¹	18,1687 ¹	12,4903 ¹
Klasse IG	14,7608 ³	15,4257 ³	10,0476 ³
Klasse IGH	17,2065 ³	19,4921 ³	13,3493 ³
Klasse IU	19,3974	21,5661	14,7124
Klasse NG	14,3316 ³	14,9110 ³	9,6735 ³
Klasse XU	20,8308	22,9751	15,5436
Klasse ZEH	6,6838 ¹	7,6710 ¹	5,2751 ¹
Klasse ZFH	6,3961 ²	7,3902 ²	5,1075 ²
Klasse ZGH	9,8431 ³	11,1531 ³	7,6437 ³
Klasse ZU	7,9952	8,8906	6,0682

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

²Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

³Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

⁴Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
AUSTRALIEN				KAIMANINSELN (Fortsetzung)					
EUR	3.708.000	APA Infrastructure Limited 1.25% 15/03/2033	2.970.329	0,35	USD	1.200.000	Tencent Holdings Limited 3.93% 19/01/2038	1.002.923	0,12
EUR	2.019.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	1.673.550	0,20	Kaimaninseln, insgesamt				
EUR	1.030.000	Ausgrid Finance Pty Limited 1.25% 30/07/2025	1.061.276	0,13	9.955.465				
USD	1.916.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	1.825.133	0,22	DÄNEMARK				
USD	3.331.000	Australia & New Zealand Banking Group Limited FRN 25/11/2035	2.579.561	0,31	EUR	576.000	Danske Bank AS FRN 15/05/2031	551.820	0,07
EUR	1.539.000	Goodman Australia Finance Pty Limited 1.38% 27/09/2025	1.534.423	0,18	USD	7.770.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	6.804.499	0,81
EUR	5.868.000	NBN Company Limited 4.13% 15/03/2029	6.522.790	0,79	Dänemark, insgesamt				
USD	2.597.000	SGSP Australia Assets Pty 3.50% 07/07/2027	2.431.441	0,29	7.356.319				
USD	7.087.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	6.842.357	0,83	FINNLAND				
Australien, insgesamt			27.440.860	3,30	EUR	5.711.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	5.261.236	0,63
				Finnland, insgesamt					
				5.261.236					
				0,63					
BERMUDAS				FRANKREICH					
USD	3.035.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	2.845.396	0,34	USD	2.674.000	BNP Paribas SA FRN 15/09/2029	2.233.041	0,27
Bermudas, insgesamt			2.845.396	0,34	USD	1.500.000	BNP Paribas SA FRN 20/01/2033	1.259.368	0,15
				FRANKREICH, insgesamt					
				29.034.553					
				3,49					
KANADA				DEUTSCHLAND					
USD	2.137.000	Enbridge Inc. 5.70% 08/03/2033	2.225.878	0,27	EUR	1.700.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	1.526.753	0,18
Kanada, insgesamt			2.225.878	0,27	EUR	6.800.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	5.460.603	0,64
				DEUTSCHLAND, insgesamt					
				1.533.680					
				0,18					
KAIMANINSELN				DEUTSCHLAND					
USD	732.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	623.927	0,07	EUR	2.500.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	2.768.797	0,33
GBP	2.333.000	Southern Water Services Finance Limited 1.63% 30/03/2027	2.496.647	0,30	EUR	3.700.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	3.310.974	0,40
GBP	2.472.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	2.647.544	0,32	EUR	1.500.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	1.533.680	0,18
GBP	1.840.000	Southern Water Services Finance Limited 3.00% 28/05/2037	1.675.156	0,20	EUR	884.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	901.333	0,11
USD	566.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050	373.842	0,04					
USD	1.208.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	1.135.426	0,14					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

		% des				% des			
Nennwert	Anlage	Marktwert USD	Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
DEUTSCHLAND (Fortsetzung)				ITALIEN					
EUR	1.700.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	1.457.962	0,17	EUR	1.066.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	975.992	0,11
USD	3.657.000	Deutsche Bank AG FRN 28/05/2032	2.828.803	0,34	EUR	901.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	849.008	0,10
EUR	1.300.000	Deutsche Bank AG FRN 05/09/2030	1.350.626	0,16	EUR	1.889.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	1.664.353	0,20
EUR	200.000	Deutsche Bank AG FRN 05/09/2030	207.789	0,02	EUR	232.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.75% 24/01/2031	249.141	0,03
USD	469.000	Deutsche Bank AG FRN 10/02/2034	436.877	0,05	EUR	773.000	ENI SpA - Perp FRN	701.694	0,08
EUR	1.800.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	1.498.810	0,18	USD	300.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	262.262	0,03
EUR	200.000	Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029	172.183	0,02	Italien, insgesamt		4.702.450	0,55	
EUR	100.000	Vier Gas Transport GmbH 0.50% 10/09/2034	73.786	0,01	JERSEY - KANALINSELN				
EUR	1.300.000	Vier Gas Transport GmbH 1.50% 25/09/2028	1.254.932	0,15	USD	1.647.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	1.357.308	0,16
EUR	2.000.000	Vier Gas Transport GmbH 4.00% 26/09/2027	2.184.341	0,26	USD	2.563.645	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.94% 30/09/2040	2.086.783	0,25
EUR	2.900.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	3.254.879	0,39	GBP	1.130.000	Heathrow Funding Limited 6.45% 10/12/2031	1.488.963	0,17
EUR	1.691.000	Volkswagen Leasing GmbH 0.63% 19/07/2029	1.477.507	0,18	Jersey - Kanalinseln, insgesamt		4.933.054	0,58	
EUR	2.800.000	Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	2.594.834	0,31	LUXEMBURG				
EUR	1.300.000	Vonovia SE 5.00% 23/11/2030	1.324.647	0,16	EUR	2.000.000	Aroundtown SA 0.00% 16/07/2026	1.546.363	0,19
Deutschland, insgesamt				4,24	EUR	3.400.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	2.479.657	0,30
INDIEN					EUR	1.500.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	1.014.596	0,12
USD	2.164.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	1.655.588	0,20	GBP	1.234.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	964.527	0,12
USD	1.580.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	1.387.652	0,17	USD	2.054.000	Aroundtown SA 5.38% 21/03/2029	1.524.915	0,18
Indien, insgesamt				0,37	EUR	2.804.000	Becton Dickinson Euro Finance SarL 0.33% 13/08/2028	2.564.325	0,31
IRLAND					EUR	2.014.000	Becton Dickinson Euro Finance SarL 1.21% 04/06/2026	2.031.051	0,24
EUR	2.019.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	1.989.501	0,24	EUR	7.100.000	Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	5.453.963	0,65
EUR	1.954.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	1.982.423	0,24	USD	2.388.000	Greensaif Pipelines Bidco SarL 6.13% 23/02/2038	2.461.247	0,30
EUR	2.111.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	1.971.910	0,24	EUR	3.288.000	P3 Group SarL 1.63% 26/01/2029	2.686.629	0,32
EUR	3.365.000	Experian Europe DAC 1.56% 16/05/2031	3.101.230	0,37	EUR	1.858.000	P3 Group SarL 1.63% 26/01/2029	1.518.174	0,18
EUR	2.243.000	Glencore Capital Finance DAC 0.75% 01/03/2029	1.973.789	0,24	EUR	1.851.000	Prologis International Funding II SA 0.75% 23/03/2033	1.335.601	0,16
Irland, insgesamt				1,33					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
LUXEMBURG (Fortsetzung)				NIEDERLANDE (Fortsetzung)			
EUR	3.746.000 SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	3.740.699	0,45	EUR	2.200.000 Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	1.795.210	0,22
	Luxemburg, insgesamt	29.321.747	3,52	GBP	1.300.000 Volkswagen Financial Services NV 1.38% 14/09/2028	1.310.205	0,16
NIEDERLANDE				GBP	1.200.000 Volkswagen Financial Services NV 2.13% 18/01/2028	1.283.937	0,15
EUR	1.101.000 ABB Finance BV 3.25% 16/01/2027	1.192.730	0,14	EUR	1.000.000 Vonovia Finance BV 1.00% 28/01/2041	527.554	0,06
EUR	302.000 Airbus SE 2.38% 09/06/2040	258.636	0,03	EUR	1.987.000 Wolters Kluwer NV 3.75% 03/04/2031	2.171.716	0,26
EUR	765.000 ASR Nederland NV FRN 07/12/2043	862.923	0,10		Niederlande, insgesamt	44.789.446	5,39
USD	1.977.000 Braskem Netherlands Finance BV 7.25% 13/02/2033	1.910.185	0,23	NORWEGEN			
EUR	4.593.000 Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	3.896.608	0,47	EUR	1.795.000 DNB Bank ASA FRN 18/01/2028	1.732.797	0,21
EUR	1.193.000 Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	913.612	0,11	USD	2.599.000 DNB Bank ASA 1.13% 16/09/2026	2.333.680	0,28
EUR	1.379.000 Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	1.056.053	0,13	EUR	1.967.000 DNB Bank ASA FRN 21/09/2027	2.102.443	0,25
GBP	3.381.000 E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	4.408.849	0,53		Norwegen, insgesamt	6.168.920	0,74
USD	279.000 E.ON International Finance BV 6.65% 30/04/2038	305.628	0,04	SPANIEN			
USD	1.067.000 EDP Finance BV 6.30% 11/10/2027	1.114.197	0,13	EUR	700.000 Banco de Sabadell SA FRN 10/11/2028	764.205	0,09
USD	1.355.000 Enel Finance International NV 6.80% 14/10/2025	1.404.353	0,17	GBP	1.500.000 Banco Santander SA FRN 30/08/2028	1.800.275	0,22
USD	2.159.000 ING Groep NV FRN 28/03/2033	1.973.162	0,24	GBP	3.000.000 Banco Santander SA 5.13% 25/01/2030	3.645.583	0,44
EUR	1.387.000 Nederlandse Gasunie NV 3.38% 11/07/2034	1.467.426	0,18	EUR	309.000 Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	313.631	0,04
EUR	617.000 Nederlandse Gasunie NV 3.38% 11/07/2034	652.777	0,08	USD	1.503.000 Telefonica Emisiones SA 5.21% 08/03/2047	1.316.538	0,16
EUR	1.870.000 Sagax Euro Mtn NL BV 0.75% 26/01/2028	1.490.259	0,18		Spanien, insgesamt	7.840.232	0,95
EUR	1.379.000 Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	1.241.734	0,15	SCHWEDEN			
EUR	618.000 Stedin Holding NV 2.38% 03/06/2030	625.679	0,08	EUR	3.521.000 Sagax AB 1.13% 30/01/2027	3.109.547	0,37
EUR	1.391.000 Stedin Holding NV 2.38% 03/06/2030	1.408.283	0,17	EUR	136.000 Sagax AB 2.00% 17/01/2024	143.941	0,02
EUR	4.823.000 Stedin Holding NV - Perp FRN	4.411.810	0,53		Schweden, insgesamt	3.253.488	0,39
EUR	1.000.000 Telefonica Europe BV FRN 12/05/2169	854.138	0,10	SCHWEIZ			
EUR	100.000 Telefonica Europe BV FRN 12/05/2170	85.414	0,01	EUR	1.346.000 Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	1.153.954	0,14
EUR	1.000.000 Telefonica Europe BV FRN 23/11/2171	1.108.425	0,13	USD	4.470.000 Credit Suisse AG 5.00% 09/07/2027	4.307.963	0,52
EUR	600.000 Telefonica Europe BV Perp FRN	637.756	0,08	USD	5.276.000 Credit Suisse Group AG FRN 14/05/2032	4.251.058	0,51
EUR	4.355.000 Tennet Holding BV FRN 22/10/2168	4.420.187	0,53	USD	1.650.000 Credit Suisse Group AG FRN 01/04/2031	1.466.933	0,18

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
SCHWEIZ (Fortsetzung)				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					
USD	1.630.000	UBS Group AG Perp FRN	1.548.839	0,19	GBP	520.000	London Power Networks plc 6.13% 07/06/2027	667.166	0,08
		Schweiz, insgesamt	12.728.747	1,54	GBP	637.000	National Gas Transmission plc 5.75% 05/04/2035	795.855	0,10
VEREINIGTES KÖNIGREICH				VEREINIGTES KÖNIGREICH					
GBP	2.456.000	Anglian Water Osprey Financing plc 2.00% 31/07/2028	2.452.147	0,29	EUR	2.038.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	2.171.674	0,26
EUR	1.459.000	Anglo American Capital plc 4.75% 21/09/2032	1.598.336	0,19	EUR	5.508.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	4.588.410	0,55
USD	691.000	Anglo American Capital plc 4.75% 16/03/2052	585.022	0,07	EUR	780.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	649.775	0,08
USD	9.062.000	Bae Systems plc 3.40% 15/04/2030	8.330.032	1,00	GBP	1.077.000	National Grid Electricity Transmission plc 1.13% 07/07/2028	1.096.602	0,13
USD	2.756.000	Barclays plc FRN 24/11/2032	2.197.182	0,26	GBP	1.000.000	National Grid Gas plc 1.13% 14/01/2033	830.835	0,10
USD	2.314.000	Barclays plc FRN 09/08/2033	2.288.507	0,27	EUR	3.177.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	2.794.188	0,33
GBP	509.000	BAT International Finance plc 2.25% 26/06/2028	517.814	0,06	USD	3.661.000	Nationwide Building Society 1.50% 13/10/2026	3.223.298	0,39
USD	2.278.000	BP Capital Markets plc FRN 22/09/2168	2.185.025	0,26	GBP	1.654.000	NatWest Markets plc 6.38% 08/11/2027	2.127.392	0,26
EUR	2.269.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	2.285.597	0,27	EUR	2.980.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	2.727.026	0,33
EUR	1.636.000	British American Tobacco plc FRN 27/12/2169	1.450.886	0,18	GBP	2.490.000	Northumbrian Water Finance plc 2.38% 05/10/2027	2.745.475	0,33
GBP	840.000	Broadgate Financing plc 5.00% 05/10/2031	1.008.486	0,12	GBP	1.126.000	Northumbrian Water Finance plc 6.38% 28/10/2034	1.500.175	0,18
GBP	530.000	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	611.270	0,07	GBP	783.000	Phoenix Group Holdings plc 5.63% 28/04/2031	877.565	0,11
EUR	1.237.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	1.084.241	0,13	GBP	420.000	Santander UK plc Perp 10.06%	753.216	0,09
EUR	951.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	833.559	0,10	GBP	587.000	Severn Trent Utilities Finance plc 5.25% 04/04/2036	720.417	0,09
GBP	1.820.000	Cadent Finance plc 2.25% 10/10/2035	1.585.285	0,19	GBP	1.121.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	1.241.193	0,15
USD	5.993.000	Diageo Capital plc 5.50% 24/01/2033	6.503.538	0,79	GBP	136.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	150.582	0,02
GBP	2.826.000	Ds Smith plc 2.88% 26/07/2029	3.012.149	0,36	GBP	457.237	Tesco Property Finance 1 plc 7.62% 13/07/2039	639.651	0,08
EUR	3.633.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	3.550.061	0,43	GBP	826.985	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	1.013.427	0,12
EUR	479.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	507.302	0,06	GBP	1.256.000	Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	1.375.183	0,16
EUR	28.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	29.654	0,00	EUR	3.407.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	3.200.477	0,38
USD	7.628.000	HSBC Holdings plc FRN 22/11/2032	6.221.725	0,75	GBP	1.133.000	Virgin Money UK plc FRN 19/08/2031	1.168.874	0,14
USD	2.899.000	HSBC Holdings plc FRN 11/08/2033	2.873.270	0,34					
USD	1.591.000	HSBC Holdings plc FRN 09/03/2044	1.687.139	0,20					
GBP	2.158.000	HSBC Holdings plc FRN 16/11/2034	2.806.267	0,34					
GBP	378.000	Legal & General Group plc FRN 01/11/2050	407.091	0,05					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
GBP	700.000 Virgin Money UK plc FRN 22/06/2025	823.660	0,10	USD	7.825.000 Bank of America Corp. FRN 11/03/2032	6.537.599	0,78
EUR	2.112.000 Virgin Money UK plc FRN 29/10/2028	2.188.920	0,26	USD	4.487.000 Bank of America Corp. FRN 04/02/2033	3.802.536	0,46
GBP	1.282.000 Wessex Water Services Finance plc 5.13% 31/10/2032	1.565.513	0,19	USD	1.669.000 Bank of America Corp. FRN 23/07/2030	1.488.010	0,18
GBP	1.070.000 Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	1.249.594	0,15	USD	2.355.000 Bayer US Finance II LLC 4.63% 25/06/2038	2.159.457	0,26
	Vereinigtes Königreich, insgesamt	99.497.728	11,94	GBP	2.479.000 Becton Dickinson & Company 3.02% 24/05/2025	2.938.938	0,35
	VEREINIGTE STAATEN			USD	6.186.000 Berkshire Hathaway Finance Corp. 3.85% 15/03/2052	5.212.577	0,62
USD	3.098.000 AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	2.737.985	0,33	USD	2.011.000 Boeing Company 3.95% 01/08/2059	1.487.504	0,18
USD	916.000 AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	884.754	0,11	USD	950.000 Boeing Company 5.93% 01/05/2060	950.106	0,11
USD	981.000 AEP Texas Inc. 3.45% 15/05/2051	717.754	0,09	USD	2.331.000 Broadcom Inc. 2.45% 15/02/2031	1.909.479	0,22
USD	6.055.000 Amazon.com Inc. 4.70% 01/12/2032	6.218.844	0,75	USD	1.150.000 Broadcom Inc. 4.15% 15/11/2030	1.067.686	0,13
USD	986.000 American Transmission Systems Inc. 2.65% 15/01/2032	833.492	0,10	USD	1.691.000 Brown-Forman Corp. 4.75% 15/04/2033	1.707.386	0,20
USD	1.515.000 Amgen Inc. 2.20% 21/02/2027	1.395.868	0,17	USD	1.271.000 Charter Communications Operating LLC 3.90% 01/06/2052	841.363	0,10
USD	1.755.000 Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	1.614.211	0,19	USD	2.314.000 Charter Communications Operating LLC 3.95% 30/06/2062	1.471.388	0,18
USD	2.025.000 Amgen Inc. 3.15% 21/02/2040	1.592.830	0,19	USD	385.000 Commonwealth Edison Company 4.00% 01/03/2049	323.188	0,04
USD	932.000 Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	791.820	0,09	USD	879.000 Commonwealth Edison Company 5.30% 01/02/2053	921.533	0,11
USD	673.000 Amgen Inc. 4.88% 01/03/2053	631.653	0,08	USD	833.000 Connecticut Light and Power Company 5.25% 15/01/2053	862.620	0,10
USD	2.578.000 Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	2.637.269	0,32	USD	340.000 Consolidated Edison Company of New York Inc. 3.95% 01/04/2050	282.815	0,03
USD	4.434.000 Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	4.557.911	0,55	USD	168.000 CSX Corp. 3.80% 01/11/2046	138.089	0,02
USD	1.326.000 Amgen Inc. 5.65% 02/03/2053	1.380.566	0,17	USD	814.000 CSX Corp. 3.80% 15/04/2050	664.339	0,08
USD	4.837.000 Amgen Inc. 5.75% 02/03/2063	5.036.152	0,59	USD	1.695.000 CSX Corp. 4.50% 15/11/2052	1.554.225	0,18
USD	2.296.000 Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	2.287.920	0,27	USD	1.625.000 Daimler Truck Finance North America LLC 5.13% 19/01/2028	1.628.681	0,20
USD	2.887.000 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	3.033.824	0,37	USD	652.000 Duke Energy Ohio Inc. 5.65% 01/04/2053	687.476	0,08
EUR	958.000 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	861.926	0,10	USD	1.077.000 Emera US Finance LP 4.75% 15/06/2046	879.613	0,11
USD	7.882.000 AstraZeneca Finance LLC 4.88% 03/03/2028	8.114.742	0,97	USD	2.133.000 Enterprise Products Operating LLC 4.45% 15/02/2043	1.906.708	0,23
USD	6.872.000 AT&T Inc. 3.50% 15/09/2053	4.997.465	0,60	USD	8.317.000 Eversource Energy 2.55% 15/03/2031	7.102.785	0,84
CAD	1.500.000 AT&T Inc. 4.00% 25/11/2025	1.090.861	0,13				
GBP	400.000 AT&T Inc. 4.38% 14/09/2029	470.400	0,06				
USD	2.240.000 AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	2.151.261	0,26				
USD	1.514.000 Bank of America Corp. FRN 21/07/2032	1.222.360	0,15				
USD	1.814.000 Bank of America Corp. FRN 13/02/2031	1.537.631	0,18				
USD	2.219.000 Bank of America Corp. FRN 29/04/2031	1.877.645	0,23				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
USD	2.196.000 Eversource Energy 4.20% 27/06/2024	2.175.210	0,26	USD	3.086.000 Lowe's Companies Inc. 5.80% 15/09/2062	3.119.044	0,37
USD	2.567.000 Eversource Energy 5.45% 01/03/2028	2.660.933	0,32	USD	1.577.000 Metropolitan Edison Company 4.30% 15/01/2029	1.515.567	0,18
USD	2.527.000 Five Corners Funding Trust III 5.79% 15/02/2033	2.594.894	0,31	USD	4.583.000 Metropolitan Life Global Funding I 1.55% 07/01/2031	3.671.701	0,44
USD	2.224.000 Ford Motor Credit Company LLC 7.35% 04/11/2027	2.301.173	0,28	EUR	4.160.000 Metropolitan Life Global Funding I 3.75% 05/12/2030	4.464.288	0,54
USD	1.000.000 GE HealthCare Technologies Inc. 6.38% 22/11/2052	1.121.065	0,13	GBP	2.156.000 Morgan Stanley FRN 18/11/2033	2.719.207	0,33
USD	551.000 Georgia Power Company 3.70% 30/01/2050	428.583	0,05	USD	7.545.000 Nestle Holdings Inc. 5.00% 14/03/2028	7.843.045	0,95
USD	1.043.000 Georgia Power Company 5.13% 15/05/2052	1.022.849	0,12	EUR	8.033.000 Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	8.425.049	1,01
USD	879.000 Goodman USA Finance Five LLC 4.63% 04/05/2032	825.103	0,10	EUR	2.740.000 Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	2.929.252	0,35
USD	398.000 Goodman USA Finance Three LLC 3.70% 15/03/2028	367.814	0,04	USD	2.594.000 New York Life Global Funding 4.55% 28/01/2033	2.569.278	0,31
USD	637.000 Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	563.870	0,07	USD	2.241.000 New York Life Global Funding 4.85% 09/01/2028	2.276.101	0,27
USD	3.640.000 HCA Inc. 5.88% 01/02/2029	3.720.800	0,45	USD	553.000 New York Life Insurance Company 4.45% 04/04/2069	490.646	0,06
EUR	2.121.000 Honeywell International Inc. 4.13% 02/11/2034	2.339.171	0,28	USD	2.243.000 NiSource Inc. 1.70% 15/02/2031	1.774.748	0,21
USD	1.098.000 Indiana Michigan Power Company 5.63% 01/04/2053	1.142.825	0,14	USD	1.598.000 NiSource Inc. 4.38% 15/05/2047	1.388.936	0,17
USD	256.000 Intel Corp. 4.75% 25/03/2050	235.075	0,03	USD	6.959.000 NiSource Inc. 4.80% 15/02/2044	6.421.718	0,77
USD	855.000 Intel Corp. 4.90% 05/08/2052	797.068	0,10	USD	800.000 NiSource Inc. 5.00% 15/06/2052	762.658	0,09
USD	2.271.000 Intel Corp. 5.13% 10/02/2030	2.312.342	0,27	USD	1.189.000 NiSource Inc. 5.25% 30/03/2028	1.213.051	0,15
GBP	2.151.000 International Business Machines Corp. 4.88% 06/02/2038	2.570.173	0,31	USD	3.960.000 Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.45% 30/03/2051	2.919.421	0,35
USD	2.369.000 Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	1.984.932	0,24	USD	682.000 Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.63% 30/09/2059	508.170	0,06
USD	1.918.000 JPMorgan Chase & Company FRN 04/02/2032	1.543.025	0,18	USD	890.000 Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.85% 30/09/2047	715.420	0,09
USD	3.911.000 JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	3.250.134	0,39	USD	2.459.000 Oracle Corp. 2.88% 25/03/2031	2.110.231	0,26
USD	9.930.000 JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	8.350.308	0,99	USD	1.319.000 Oracle Corp. 3.60% 01/04/2040	1.024.017	0,12
USD	4.888.000 JPMorgan Chase & Company FRN 25/01/2033	4.190.081	0,50	USD	1.346.000 Oracle Corp. 3.65% 25/03/2041	1.042.551	0,12
USD	1.785.000 Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	1.572.790	0,19	USD	5.314.000 Pacific Gas and Electric Company 4.95% 01/07/2050	4.389.225	0,53
USD	1.220.000 Kinder Morgan Inc. 5.20% 01/06/2033	1.211.522	0,15	USD	1.174.000 Pacific Gas and Electric Company 6.75% 15/01/2053	1.213.714	0,15
GBP	4.150.000 Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	4.962.149	0,59	USD	718.000 Piedmont Natural Gas Company Inc. 3.35% 01/06/2050	506.801	0,06
USD	785.000 Lowe's Companies Inc. 5.75% 01/07/2053	800.564	0,10	USD	588.000 Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	523.027	0,06
				USD	2.680.000 Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	2.109.267	0,25
				USD	814.000 PPL Electric Utilities Corp 4.15% 15/06/2048	727.930	0,09
				USD	4.991.000 PPL Electric Utilities Corp. 5.00% 15/05/2033	5.098.683	0,61

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					
USD	625.000	Public Service Company of Colorado 5.25% 01/04/2053	637.114	0,08	USD	1.297.000	UnitedHealth Group Inc. 6.05% 15/02/2063	1.477.629	0,18
USD	3.964.000	Public Service Electric and Gas Company 4.65% 15/03/2033	3.985.666	0,48	USD	4.039.000	Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	3.842.697	0,46
USD	1.503.000	RELX Capital Inc. 4.75% 20/05/2032	1.494.230	0,18	USD	8.651.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	7.024.227	0,84
USD	2.470.000	Republic Services Inc. 4.88% 01/04/2029	2.499.865	0,30	USD	5.147.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.39% 15/03/2062	4.167.918	0,50
USD	2.829.000	Roche Holdings Inc. 1.93% 13/12/2028	2.490.477	0,30	USD	4.644.000	Williams Cos IncThe 2.60% 15/03/2031	3.908.103	0,46
USD	516.000	Southern California Edison Company 3.65% 01/02/2050	398.248	0,05	USD	1.274.000	Williams Partners LP 4.85% 01/03/2048	1.131.849	0,14
USD	734.000	Southern California Edison Company 4.13% 01/03/2048	610.003	0,07	Vereinigte Staaten, insgesamt		299.994.260	35,94	
USD	744.000	Southern California Gas Company 3.95% 15/02/2050	601.754	0,07	Anleihen, insgesamt		647.031.988	77,58	
EUR	1.105.000	Southern Company FRN 15/09/2081	951.844	0,11	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
EUR	134.000	Southern Company FRN 15/09/2081	115.427	0,01	KANADA				
USD	956.000	Southern Company 5.70% 15/10/2032	1.008.037	0,12	CAD	6.845.000	Canada (Govt of) 1.00% 01/09/2026	4.700.079	0,56
USD	2.299.000	Stellantis Finance USA Inc. 6.38% 12/09/2032	2.413.061	0,28	CAD	4.186.000	Canada (Govt of) 2.75% 01/12/2048	2.918.415	0,35
USD	1.894.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.90% 15/09/2044	1.755.164	0,21	Kanada, insgesamt		7.618.494	0,91	
GBP	1.514.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	1.807.349	0,22	DEUTSCHLAND				
USD	1.048.000	T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	924.343	0,11	EUR	3.557.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2052	1.989.871	0,24
USD	1.974.000	T-Mobile USA Inc. 2.88% 15/02/2031	1.704.125	0,20	EUR	3.118.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 15/09/2028	2.904.403	0,35
USD	1.615.000	T-Mobile USA Inc. 3.40% 15/10/2052	1.164.894	0,14	GBP	4.900.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3.88% 02/09/2025	5.997.035	0,72
USD	3.732.000	T-Mobile USA Inc. 4.95% 15/03/2028	3.767.995	0,45	Deutschland, insgesamt		10.891.309	1,31	
USD	1.901.000	T-Mobile USA Inc. 5.05% 15/07/2033	1.911.294	0,23	JAPAN				
USD	441.000	T-Mobile USA Inc. 5.80% 15/09/2062	457.214	0,05	JPY	549.600.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.40% 20/06/2049	3.360.161	0,40
USD	566.000	TSMC Arizona Corp. 2.50% 25/10/2031	485.558	0,06	Japan, insgesamt		3.360.161	0,40	
USD	2.866.000	UnitedHealth Group Inc. 4.50% 15/04/2033	2.851.246	0,34	SUPRANATIONAL				
USD	1.815.000	UnitedHealth Group Inc. 4.95% 15/05/2062	1.768.277	0,21	EUR	2.300.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.00% 15/01/2027	2.231.739	0,27
USD	5.608.000	UnitedHealth Group Inc. 5.30% 15/02/2030	5.918.208	0,71					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)			
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
SUPRANATIONAL (Fortsetzung)				NORWEGEN			
USD	5.465.000			USD	200.000		
	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 11/03/2025	5.124.615	0,61		DNB Bank ASA FRN 09/10/2026	201.942	0,02
USD	4.000.000				Norwegen, insgesamt	201.942	0,02
	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 24/11/2027	3.494.557	0,42	VEREINIGTE STAATEN			
	Supranational, insgesamt	10.850.911	1,30	USD	1.936.000		
VEREINIGTES KÖNIGREICH					Atlantic City Electric 2.30% 15/03/2031	1.636.540	0,20
GBP	996.000			USD	1.352.000		
	United Kingdom Gilt 3.75% 22/07/2052	1.212.170	0,15		Broadcom Inc. 4.93% 15/05/2037	1.231.822	0,15
	Vereinigtes Königreich, insgesamt	1.212.170	0,15	USD	5.623.000		
VEREINIGTE STAATEN					Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	4.930.407	0,59
USD	11.280.000			USD	3.920.000		
	United States Treasury N/B 1.13% 15/08/2040	7.468.594	0,90		GE HealthCare Technologies Inc. 5.86% 15/03/2030	4.105.880	0,50
USD	32.215.700			USD	3.141.000		
	United States Treasury N/B 2.00% 15/11/2041	24.355.571	2,91		HCA Inc. 3.63% 15/03/2032	2.770.772	0,33
USD	13.499.700			USD	1.200.000		
	United States Treasury N/B 2.75% 30/04/2027	13.014.555	1,56	USD	1.548.000		
	Vereinigte Staaten, insgesamt	44.838.720	5,37		Verizon Communications Inc. 2.36% 15/03/2032	1.272.502	0,15
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt					Vereinigte Staaten, insgesamt	16.948.726	2,04
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt					Anleihen, insgesamt	18.249.693	2,19
					Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt	18.249.693	2,19
				Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
				Anleihen			
				AUSTRALIEN			
				USD	2.913.000		
					APA Infrastructure Limited 4.25% 15/07/2027	2.820.688	0,34
					Australien, insgesamt	2.820.688	0,34
				BERMUDAS			
Anleihen				USD	700.000		
AUSTRALIEN					Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	695.746	0,08
USD	817.000				Bermudas, insgesamt	695.746	0,08
	NBN Company Limited 2.63% 05/05/2031	692.833	0,08	KANADA			
	Australien, insgesamt	692.833	0,08	CAD	1.980.000		
NIEDERLANDE					Rogers Communications Inc. 3.65% 31/03/2027	1.410.868	0,17
USD	409.000				Kanada, insgesamt	1.410.868	0,17
	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	406.192	0,05				
	Niederlande, insgesamt	406.192	0,05				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
----------	--------	------------------	--

Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente (Fortsetzung)

Anleihen (Fortsetzung)

PORTUGAL

EUR	200.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	23.902	0,00
		Portugal, insgesamt	23.902	0,00

VEREINIGTE STAATEN

USD	883.000	Metropolitan Edison Company 5.20% 01/04/2028	892.601	0,11
USD	2.830.000	Metropolitan Life Global Funding I 5.15% 28/03/2033	2.860.309	0,34
USD	4.100.000	Pacific Life Global Funding II 4.90% 04/04/2028	4.105.179	0,49
USD	495.000	Peachtree Fund Trust 3.98% 15/02/2025	480.897	0,06
USD	2.991.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	2.526.194	0,30
		Vereinigte Staaten, insgesamt	10.865.180	1,30

Anleihen, insgesamt **15.816.384** **1,89**

**Sonstige übertragbare Wertpapiere und
Geldmarktinstrumente, insgesamt** **15.816.384** **1,89**

Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren

Fonds

IRLAND

	35.269.617	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	35.269.617	4,23
		Irland, insgesamt	35.269.617	4,23
		Fonds, insgesamt	35.269.617	4,23

**Organismen für gemeinsame Anlagen in
übertragbaren Wertpapieren, insgesamt** **35.269.617** **4,23**

Wert der Anlagen, insgesamt **795.139.447** **95,33**

(Gesamtkosten: USD 848.154.775)

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

**Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
AUSTRALIEN				FINNLAND					
EUR	483.000	APA Infrastructure Limited 1.25% 15/03/2033	356.124	0,44	EUR	788.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	668.178	0,83
EUR	239.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	182.344	0,23	Finnland, insgesamt			668.178	0,83
EUR	94.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	71.717	0,09	FRANKREICH				
EUR	876.000	Ausgrid Finance Pty Limited 1.25% 30/07/2025	830.779	1,04	EUR	399.000	AXA SA 3.75% 12/10/2030	401.950	0,50
EUR	594.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd 0.63% 25/08/2030	472.458	0,59	EUR	235.000	AXA SA FRN 10/03/2043	214.427	0,27
EUR	723.000	Australia & New Zealand Banking Group Limited FRN 05/05/2031	630.207	0,79	USD	930.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.60% 04/10/2026	751.701	0,94
EUR	494.000	Goodman Australia Finance Pty Limited 1.38% 27/09/2025	453.340	0,57	EUR	200.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 3.63% 14/09/2032	197.210	0,25
EUR	431.000	National Australia Bank Limited 2.13% 24/05/2028	403.832	0,50	EUR	600.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	432.081	0,54
EUR	645.000	NBN Company Limited 4.13% 15/03/2029	659.922	0,82	USD	1.241.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	1.002.134	1,25
EUR	700.000	Westpac Banking Corp. 3.80% 17/01/2030	695.895	0,87	EUR	200.000	BPCE SA 4.00% 29/11/2032	200.497	0,25
Australien, insgesamt		4.756.618	5,94		EUR	200.000	Credit Agricole SA 1.13% 24/02/2029	173.331	0,22
BELGIEN					EUR	400.000	Credit Agricole SA 2.50% 29/08/2029	375.213	0,47
EUR	325.000	Anheuser-Busch InBev SA/ NV 3.70% 02/04/2040	307.325	0,38	EUR	400.000	Credit Agricole SA 4.00% 18/01/2033	408.616	0,51
EUR	52.000	Anheuser-Busch InBev SA/ NV 3.70% 02/04/2040	49.172	0,06	GBP	400.000	Credit Agricole SA 4.88% 23/10/2029	449.502	0,56
EUR	500.000	Argenta Spaarbank NV FRN 08/02/2029	407.042	0,51	EUR	600.000	Danone SA 2.60% 28/06/2023	599.479	0,75
EUR	400.000	Belfius Bank SA - Perp FRN	286.771	0,36	EUR	100.000	Electricite de France SA 2.00% 09/12/2049	60.873	0,08
EUR	1.200.000	Elia Transmission Belgium SA 0.88% 28/04/2030	1.007.184	1,27	EUR	100.000	Electricite de France SA 4.25% 25/01/2032	99.306	0,12
Belgien, insgesamt		2.057.494	2,58		EUR	500.000	Electricite de France SA 4.38% 12/10/2029	507.480	0,63
BERMUDAS					EUR	200.000	Electricite de France SA FRN 06/12/2171	196.158	0,24
USD	500.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	431.463	0,54	EUR	200.000	ELO SACA 4.88% 08/12/2028	191.114	0,24
Bermudas, insgesamt		431.463	0,54		EUR	428.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	349.004	0,44
DÄNEMARK					EUR	200.000	La Banque Postale SA FRN 26/01/2031	176.705	0,22
USD	775.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	624.694	0,78	EUR	300.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0.63% 08/07/2032	232.802	0,29
Dänemark, insgesamt		624.694	0,78		EUR	400.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0.75% 12/01/2034	303.041	0,38
					EUR	200.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 1.50% 27/09/2030	173.404	0,22
					EUR	700.000	SANEF SA 1.88% 16/03/2026	665.985	0,84
					EUR	700.000	Schneider Electric SE 0.25% 09/09/2024	673.035	0,84
					EUR	600.000	Suez SACA 1.88% 24/05/2027	560.053	0,70

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
FRANKREICH (Fortsetzung)				ITALIEN			
EUR	400.000 Suez SACA 4.63% 03/11/2028	411.602	0,51	EUR	214.000 Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	172.341	0,22
EUR	500.000 TotalEnergies SE - Perp FRN	415.229	0,52	EUR	283.000 Assicurazioni Generali SpA 5.00% 08/06/2048	278.925	0,35
	Frankreich, insgesamt	10.221.932	12,78	EUR	149.000 Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	129.230	0,16
DEUTSCHLAND				EUR	358.000 Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	290.327	0,36
EUR	900.000 Allianz SE FRN 08/07/2050	734.376	0,91	EUR	100.000 Autostrade per l'Italia SpA 4.75% 24/01/2031	98.843	0,12
EUR	200.000 Allianz SE FRN 05/07/2052	184.174	0,23	EUR	195.000 ENI SpA - Perp FRN	162.927	0,20
EUR	600.000 Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	495.977	0,62	USD	500.000 Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	402.323	0,50
EUR	1.000.000 Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	739.132	0,92	EUR	309.000 Snam SpA 0.00% 15/08/2025	284.553	0,36
EUR	100.000 Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	101.939	0,13	EUR	250.000 Terna - Rete Elettrica Nazionale FRN 09/02/2171	209.544	0,26
EUR	700.000 BASF SE 4.00% 08/03/2029	718.685	0,90		Italien, insgesamt	2.029.013	2,53
EUR	400.000 Commerzbank AG FRN 29/12/2031	329.461	0,41	JAPAN			
EUR	200.000 Commerzbank AG FRN 05/12/2030	188.219	0,23	EUR	512.000 Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0.01% 10/09/2025	468.429	0,58
EUR	400.000 Commerzbank AG FRN 21/03/2028	392.415	0,49		Japan, insgesamt	468.429	0,58
EUR	700.000 Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	552.567	0,70	JERSEY - KANALINSELN			
EUR	200.000 Deutsche Bank AG FRN 05/09/2030	191.255	0,24	EUR	357.000 Heathrow Funding Limited 1.88% 14/03/2034	281.648	0,35
EUR	400.000 Hannover Rueck SE FRN 26/08/2043	408.844	0,51	GBP	234.000 Heathrow Funding Limited 6.45% 10/12/2031	283.800	0,35
EUR	400.000 Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	306.566	0,38		Jersey - Kanalinseln, insgesamt	565.448	0,70
EUR	400.000 Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029	316.964	0,40	LUXEMBURG			
EUR	900.000 Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	929.758	1,16	EUR	600.000 Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	402.767	0,50
EUR	300.000 Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	158.138	0,20	EUR	600.000 Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	373.546	0,47
EUR	600.000 Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	511.792	0,64	EUR	300.000 Aroundtown SA 1.63% 31/01/2028	198.009	0,25
EUR	300.000 Vonovia SE 5.00% 23/11/2030	281.364	0,35	EUR	347.000 Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	217.163	0,27
	Deutschland, insgesamt	7.541.626	9,42	EUR	1.200.000 Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	848.447	1,05
IRLAND				EUR	433.000 Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	298.213	0,38
EUR	370.000 AIB Group plc FRN 30/05/2031	335.583	0,42	EUR	521.000 P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	391.836	0,49
EUR	500.000 AIB Group plc FRN 19/11/2029	466.909	0,58	EUR	300.000 Prologis International Funding II SA 4.63% 21/02/2035	280.612	0,35
EUR	420.000 Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	361.109	0,45				
EUR	355.000 Experian Europe DAC 1.56% 16/05/2031	301.139	0,38				
	Irland, insgesamt	1.464.740	1,83				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)				
LUXEMBURG (Fortsetzung)				NIEDERLANDE (Fortsetzung)				
EUR	825.000 SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	758.278	0,95	EUR	717.000 Stedin Holding NV - Perp FRN	603.683	0,75	
	Luxemburg, insgesamt	3.768.871	4,71	EUR	100.000 Telefonica Europe BV FRN 23/11/2171	102.023	0,13	
NIEDERLANDE				EUR	300.000 Telefonica Europe BV - Perp FRN	249.999	0,31	
EUR	100.000 ABB Finance BV 3.25% 16/01/2027	99.711	0,12	EUR	400.000 Telefonica Europe BV Perp FRN	391.339	0,49	
EUR	176.000 Achmea BV 3.63% 29/11/2025	175.668	0,22	EUR	437.000 Tennet Holding BV FRN 22/10/2168	408.248	0,51	
EUR	300.000 Airbus SE 2.38% 09/06/2040	236.479	0,30	EUR	485.000 TenneT Holding BV 1.63% 17/11/2026	463.637	0,58	
EUR	265.000 Alliander NV 2.63% 09/09/2027	258.086	0,32	EUR	463.000 TenneT Holding BV 2.13% 17/11/2029	434.301	0,54	
EUR	300.000 Allianz Finance II BV 0.00% 22/11/2026	269.309	0,34	EUR	380.000 TenneT Holding BV 4.50% 28/10/2034	409.205	0,51	
EUR	194.000 ASR Nederland NV FRN 07/12/2043	201.420	0,25	EUR	400.000 Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	300.430	0,37	
EUR	302.000 Diageo Capital BV 1.88% 08/06/2034	255.294	0,32	GBP	1.600.000 Volkswagen Financial Services NV 1.38% 14/09/2028	1.484.246	1,85	
EUR	538.000 Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	420.110	0,52	EUR	300.000 Vonovia Finance BV 1.00% 28/01/2041	145.673	0,18	
EUR	345.000 Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	243.182	0,30	EUR	249.000 Wolters Kluwer NV 3.00% 23/09/2026	246.148	0,31	
EUR	160.000 Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	112.780	0,14	EUR	234.000 Wolters Kluwer NV 3.75% 03/04/2031	235.403	0,29	
USD	251.000 Enel Finance International NV 6.80% 14/10/2025	239.442	0,30	Niederlande, insgesamt			13.067.634	16,29
EUR	482.000 Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	377.078	0,47	NORWEGEN				
EUR	56.000 Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	43.810	0,05	USD	1.319.000 DNB Bank ASA FRN 30/09/2025	1.135.086	1,41	
EUR	327.000 Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	267.184	0,33	EUR	679.000 DNB Bank ASA FRN 14/03/2029	689.890	0,86	
EUR	300.000 ING Groep NV FRN 01/02/2030	236.030	0,29	Norwegen, insgesamt			1.824.976	2,27
EUR	300.000 ING Groep NV FRN 29/11/2030	239.670	0,30	PORTUGAL				
EUR	500.000 ING Groep NV FRN 16/02/2031	420.851	0,53	EUR	100.000 Caixa Geral de Depositos SA FRN 31/10/2028	103.298	0,13	
EUR	937.000 RELX Finance BV 1.00% 22/03/2024	911.959	1,14	Portugal, insgesamt			103.298	0,13
EUR	345.000 Royal Schiphol Group NV 0.75% 22/04/2033	262.443	0,33	SPANIEN				
EUR	345.000 Sagax Euro Mtn NL BV 0.75% 26/01/2028	253.064	0,32	EUR	600.000 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 4.38% 14/10/2029**	615.915	0,77	
EUR	345.000 Shell International Finance BV 1.88% 07/04/2032	298.112	0,37	EUR	100.000 Banco de Sabadell SA FRN 10/11/2028	100.485	0,13	
EUR	700.000 Siemens Financieringsmaatschappij NV 3.38% 24/08/2031	702.328	0,88	GBP	200.000 Banco Santander SA FRN 30/08/2028	220.937	0,28	
EUR	909.000 Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	753.387	0,94	Spanien, insgesamt			937.337	1,18
EUR	339.000 Stedin Holding NV 2.38% 03/06/2030	315.902	0,39					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*						
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)									
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)									
SCHWEDEN				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)									
EUR	606.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	492.599	0,61	EUR	401.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	307.470	0,38				
		Schweden, insgesamt	492.599	0,61	EUR	368.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	282.167	0,35				
SCHWEIZ				EUR				417.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	337.571	0,42		
EUR	874.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	689.676	0,86	USD	898.000	Nationwide Building Society 1.50% 13/10/2026	727.725	0,91				
EUR	519.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	340.784	0,43	USD	576.000	NatWest Markets plc 1.60% 29/09/2026	462.957	0,58				
EUR	5.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	3.283	0,00	GBP	290.000	NatWest Markets plc 6.38% 08/11/2027	343.321	0,43				
EUR	200.000	Credit Suisse Group AG FRN 02/04/2032	167.599	0,21	EUR	601.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	506.218	0,63				
EUR	200.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	155.124	0,19	EUR	480.000	Thames Water Kemble Finance plc 0.19% 23/10/2023	471.161	0,59				
		Schweiz, insgesamt	1.356.466	1,69	EUR	295.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	255.067	0,32				
VEREINIGTES KÖNIGREICH				GBP				820.000	Virgin Money UK plc FRN 24/04/2026	865.602	1,08		
EUR	213.000	Anglo American Capital plc 4.75% 21/09/2032	214.775	0,27	EUR	167.000	Virgin Money UK plc FRN 29/10/2028	159.310	0,20				
EUR	336.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	250.268	0,31	Vereinigtes Königreich, insgesamt				10.311.574	12,86			
EUR	173.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	128.858	0,16	VEREINIGTE STAATEN				EUR	441.000	Air Products and Chemicals Inc. 4.00% 03/03/2035	444.090	0,55
EUR	534.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	495.104	0,62	USD	313.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	294.718	0,37				
EUR	415.000	British American Tobacco plc FRN 27/12/2169	338.757	0,42	USD	324.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	306.553	0,38				
EUR	51.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	41.145	0,05	EUR	217.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	179.703	0,22				
EUR	345.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	278.333	0,35	EUR	200.000	AT&T Inc. 1.80% 14/09/2039	140.395	0,18				
GBP	491.524	Delamare Finance plc 5.55% 19/02/2029	556.385	0,69	EUR	81.000	AT&T Inc. 1.80% 14/09/2039	56.860	0,07				
EUR	420.000	Diageo Finance plc 0.50% 19/06/2024	406.006	0,51	EUR	227.000	AT&T Inc. 3.15% 04/09/2036	201.466	0,25				
EUR	330.000	Diageo Finance plc 1.00% 22/04/2025	315.075	0,39	EUR	242.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	192.089	0,24				
EUR	332.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	298.606	0,38	EUR	345.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	273.846	0,34				
EUR	415.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	404.547	0,50	EUR	277.000	Bank of America Corp. FRN 27/04/2033	247.315	0,31				
USD	784.000	HSBC Holdings plc FRN 11/08/2033	715.212	0,89	EUR	319.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 1.50% 18/03/2030	280.797	0,35				
EUR	475.000	Imperial Brands Finance plc 3.38% 26/02/2026	465.508	0,58	EUR	185.000	Exxon Mobil Corp. 0.52% 26/06/2028	159.279	0,20				
EUR	328.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	276.413	0,34									
EUR	416.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	408.013	0,51									

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)						
Anleihen (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				SUPRANATIONAL						
EUR	485.000	General Motors Financial Company Inc. 0.60% 20/05/2027	419.474	0,52	EUR	754.000	European Bank for Reconstruction & Development 0.00% 10/01/2024	735.576	0,92	
EUR	200.000	General Motors Financial Company Inc. 4.30% 15/02/2029	197.236	0,25	EUR	742.000	European Investment Bank 0.00% 15/11/2027	650.589	0,81	
EUR	470.000	Honeywell International Inc. 4.13% 02/11/2034	477.100	0,60	EUR	1.044.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.00% 15/01/2027	932.409	1,17	
EUR	368.000	International Business Machines Corp. 3.63% 06/02/2031	368.033	0,46	Supranational, insgesamt			2.318.574	2,90	
EUR	486.000	JPMorgan Chase & Company FRN 17/02/2033	362.926	0,45	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt				4.710.976	5,88
EUR	323.000	JPMorgan Chase & Company FRN 23/03/2030	285.715	0,36	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt				77.490.393	96,71
EUR	505.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	470.984	0,59	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere					
EUR	688.000	Metropolitan Life Global Funding I 3.75% 05/12/2030	679.575	0,85	Anleihen					
EUR	1.242.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	1.198.966	1,50	NIEDERLANDE					
EUR	488.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	480.193	0,60	USD	1.150.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	1.051.225	1,30	
EUR	859.000	New York Life Global Funding 3.63% 09/01/2030	839.891	1,04	Niederlande, insgesamt			1.051.225	1,30	
EUR	547.000	Northwestern Mutual Global Funding 4.11% 15/03/2030	554.299	0,69	Anleihen, insgesamt				1.051.225	1,30
EUR	181.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	116.015	0,14	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt				1.051.225	1,30
EUR	440.000	Verizon Communications Inc. 0.75% 22/03/2032	337.565	0,42	Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					
EUR	505.000	Verizon Communications Inc. 4.25% 31/10/2030	521.944	0,65	Anleihen					
Vereinigte Staaten, insgesamt			10.087.027	12,58	PORTUGAL					
Anleihen, insgesamt			72.779.417	90,83	EUR	600.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	66.000	0,08	
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente					Portugal, insgesamt			66.000	0,08	
DEUTSCHLAND					Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					
EUR	211.000	Germany (Govt of) 0.00% 09/10/2026	193.945	0,24	Anleihen					
EUR	565.000	Germany (Govt of) 0.00% 16/04/2027	513.851	0,64	PORTUGAL					
EUR	132.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/05/2036	96.609	0,12	EUR	600.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	66.000	0,08	
EUR	780.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 18/02/2025	738.158	0,92	Portugal, insgesamt			66.000	0,08	
EUR	879.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.05% 30/05/2024	849.839	1,06	Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					
Deutschland, insgesamt			2.392.402	2,98	Anleihen					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)				
VEREINIGTES KÖNIGREICH				
EUR	350.000	Lehman Brothers UK Capital Funding III LP Perp 3.88%**	0	0,00
		Vereinigtes Königreich, insgesamt	0	0,00
		Anleihen, insgesamt	66.000	0,08
		Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt	66.000	0,08
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren				
Fonds				
IRLAND				
	52	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	5.189	0,01
		Irland, insgesamt	5.189	0,01
		Fonds, insgesamt	5.189	0,01
		Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt	5.189	0,01
		Wert der Anlagen, insgesamt	78.612.807	98,10
		(Gesamtkosten: EUR 86.746.277)		

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

**Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
BELGIEN				FRANKREICH (Fortsetzung)					
EUR	1.050.000	Azelis Finance NV 5.75% 15/03/2028	1.065.749	0,26	EUR	2.500.000	Casino Guichard Perrachon SA 3.58% 07/02/2025	768.856	0,19
EUR	3.100.000	Belfius Bank SA Perp FRN	3.007.000	0,75	EUR	885.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	271.916	0,07
EUR	900.000	Solvay SA FRN 02/03/2169	807.293	0,20	EUR	433.000	Chrome Bidco SASU 3.50% 31/05/2028	361.129	0,09
EUR	300.000	Solvay SA Perp FRN	298.463	0,07	EUR	334.000	Chrome Holdco SASU 5.00% 31/05/2029	248.361	0,06
Belgien, insgesamt			5.178.505	1,28	EUR	2.946.000	Constellium SE 3.13% 15/07/2029	2.396.999	0,60
KANADA				EUR	1.126.000	Crown European Holdings SA 2.63% 30/09/2024	1.103.939	0,27	
EUR	1.193.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	1.040.864	0,26	EUR	587.000	Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026	563.870	0,14
Kanada, insgesamt			1.040.864	0,26	EUR	650.000	Crown European Holdings SA 3.38% 15/05/2025	640.792	0,16
TSCHECHISCHE REPUBLIK				EUR	3.000.000	Electricite de France SA FRN 01/06/2170	2.388.137	0,59	
EUR	937.000	Allwyn International AS 4.13% 20/11/2024	923.607	0,23	EUR	1.800.000	Electricite de France SA FRN 15/03/2169	1.513.552	0,38
Tschechische Republik, insgesamt			923.607	0,23	EUR	3.600.000	Electricite de France SA FRN 22/01/2049	3.332.965	0,82
FINNLAND				EUR	2.400.000	Electricite de France SA FRN 29/12/2049	2.300.725	0,57	
EUR	683.000	Teollisuuden Voima Oyj 1.13% 09/03/2026	622.055	0,15	GBP	1.300.000	Electricite de France SA FRN 31/12/2049	1.231.201	0,31
EUR	594.000	Teollisuuden Voima Oyj 1.38% 23/06/2028	509.193	0,13	EUR	600.000	Electricite de France SA FRN 06/12/2171	588.475	0,15
EUR	339.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.13% 04/02/2025	327.048	0,08	EUR	400.000	Electricite de France SA - Perp FRN	299.942	0,07
EUR	1.936.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.63% 31/03/2027	1.816.836	0,45	EUR	1.231.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	1.081.035	0,27
Finnland, insgesamt			3.275.132	0,81	EUR	600.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	567.430	0,14
FRANKREICH				EUR	1.054.000	Emeria SASU 7.75% 31/03/2028	1.002.899	0,25	
EUR	400.000	Accor SA - Perp FRN	389.423	0,10	EUR	5.152.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2027	4.507.112	1,12
EUR	400.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	373.670	0,09	EUR	100.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	81.543	0,02
EUR	1.287.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	1.009.921	0,25	EUR	2.261.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	2.015.909	0,50
EUR	542.000	Altice France SA 4.00% 15/07/2029	407.985	0,10	EUR	100.000	Faurecia SE 3.13% 15/06/2026	94.041	0,02
EUR	561.000	Altice France SA 4.13% 15/01/2029	434.016	0,11	EUR	1.163.000	Faurecia SE 3.75% 15/06/2028	1.044.700	0,26
EUR	104.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	78.417	0,02	EUR	633.000	Faurecia SE 7.25% 15/06/2026	654.231	0,16
EUR	1.264.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	953.065	0,24	EUR	576.000	Foncia Management SA 3.38% 31/03/2028	457.261	0,11
EUR	2.385.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	2.113.706	0,52	EUR	685.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	666.041	0,17
EUR	1.421.000	CAB Selas 3.38% 01/02/2028	1.170.206	0,29	EUR	1.864.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	1.812.410	0,45
					EUR	4.077.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	3.936.678	0,98
					EUR	1.185.000	Iliad Holding SASU 5.63% 15/10/2028	1.105.970	0,27
					EUR	500.000	iliad SA 1.88% 11/02/2028	420.966	0,10
					EUR	1.300.000	iliad SA 5.38% 14/06/2027	1.292.081	0,32

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
FRANKREICH (Fortsetzung)				DEUTSCHLAND (Fortsetzung)					
EUR	700.000	iliad SA 5.63% 15/02/2030	680.479	0,17	EUR	500.000	Bayer AG FRN 25/03/2082	461.153	0,11
EUR	500.000	Iliad SA 0.75% 11/02/2024	486.368	0,12	EUR	2.124.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	1.965.742	0,49
EUR	400.000	Iliad SA 2.38% 17/06/2026	367.737	0,09	EUR	265.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	247.407	0,06
EUR	578.000	Laboratoire Eimer Selas 5.00% 01/02/2029	435.465	0,11	EUR	598.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	558.300	0,14
EUR	1.484.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	1.446.523	0,36	EUR	400.000	Deutsche Bank AG FRN 30/04/2171	373.167	0,09
EUR	429.000	Loxam SAS 3.75% 15/07/2026	399.525	0,10	EUR	500.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	482.440	0,12
EUR	305.000	Loxam SAS 5.75% 15/07/2027	264.293	0,07	EUR	3.500.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	3.164.217	0,79
EUR	200.000	Orano SA 3.38% 23/04/2026	194.553	0,05	EUR	2.800.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	2.615.133	0,65
EUR	1.389.000	Paprec Holding SA 3.50% 01/07/2028	1.217.286	0,30	EUR	1.400.000	Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	1.279.914	0,32
EUR	1.511.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	1.496.723	0,36	EUR	1.649.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	1.560.942	0,39
EUR	1.242.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	1.253.048	0,31	EUR	804.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	733.092	0,18
EUR	429.000	Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026	383.661	0,10	EUR	1.285.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	1.171.670	0,29
EUR	500.000	Renault SA 1.25% 24/06/2025	463.078	0,11	EUR	599.000	HT Troplast GmbH 9.25% 15/07/2025	594.545	0,15
EUR	400.000	Renault SA 2.00% 28/09/2026	357.316	0,09	EUR	550.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.88% 15/05/2027	484.881	0,12
EUR	1.000.000	Renault SA 2.38% 25/05/2026	916.864	0,23	EUR	2.115.876	IHO Verwaltungs GmbH 8.75% 15/05/2028	2.169.770	0,54
EUR	400.000	Renault SA 2.50% 02/06/2027	353.334	0,09	EUR	100.000	Ineos Styrolution Group GmbH 2.25% 16/01/2027	87.013	0,02
EUR	1.455.000	Rexel SA 2.13% 15/06/2028	1.283.706	0,32	EUR	500.000	Infineon Technologies AG FRN 01/04/2168	475.250	0,12
EUR	961.000	Rexel SA 2.13% 15/12/2028	838.597	0,21	EUR	500.000	Infineon Technologies AG FRN 01/04/2168	455.363	0,11
EUR	103.000	Rexel SA 2.13% 15/12/2028	89.881	0,02	EUR	3.400.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	2.605.813	0,65
EUR	2.132.000	Solvay Finance SACA Perp FRN	2.128.361	0,54	EUR	2.626.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	2.292.104	0,57
EUR	1.200.000	SPIE SA 2.63% 18/06/2026	1.132.020	0,28	EUR	1.548.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	1.345.258	0,33
EUR	716.000	Tereos Finance Groupe I SA 7.25% 15/04/2028	703.974	0,17	EUR	1.318.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	1.073.460	0,26
EUR	300.000	Valeo 1.00% 03/08/2028	239.963	0,06	EUR	434.000	ProGroup AG 3.00% 31/03/2026	405.921	0,10
EUR	500.000	Valeo 1.50% 18/06/2025	472.360	0,12	EUR	1.300.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	1.263.540	0,31
EUR	600.000	Valeo 1.63% 18/03/2026	552.820	0,14	EUR	900.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	874.759	0,22
EUR	1.300.000	Valeo 5.38% 28/05/2027	1.296.151	0,32	EUR	1.200.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	1.101.502	0,27
EUR	600.000	Veolia Environnement SA FRN 15/02/2171	499.166	0,12	EUR	700.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	642.543	0,16
EUR	1.100.000	Veolia Environnement SA FRN 20/04/2169	989.192	0,25	EUR	1.629.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 2.00% 15/07/2025	1.521.573	0,38
EUR	300.000	Veolia Environnement SA FRN 20/04/2170	269.779	0,07					
EUR	400.000	Veolia Environnement SA FRN 20/04/2171	328.766	0,08					
EUR	1.400.000	Verallia SA 1.63% 14/05/2028	1.228.616	0,31					
		Frankreich, insgesamt	68.451.180	17,00					
DEUTSCHLAND									
EUR	500.000	Bayer AG FRN 12/11/2079	465.598	0,12					
EUR	1.100.000	Bayer AG FRN 12/11/2079	955.655	0,24					
EUR	2.500.000	Bayer AG FRN 25/03/2082	2.324.281	0,57					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
DEUTSCHLAND (Fortsetzung)				ITALIEN (Fortsetzung)			
EUR	1.251.099			EUR	1.327.000		
	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	1.192.363	0,30	EUR	928.000	1.211.351	0,30
EUR	200.000				Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2.63% 28/04/2025	884.578	0,22
	ZF Finance GmbH 2.00% 06/05/2027	173.159	0,04	EUR	310.000		
EUR	100.000				Banca Monte dei Paschi di Siena SpA FRN 02/03/2026	304.055	0,08
	ZF Finance GmbH 2.75% 25/05/2027	89.453	0,02	EUR	1.687.000		
EUR	1.200.000				FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	1.506.913	0,37
	ZF Finance GmbH 3.00% 21/09/2025	1.143.666	0,28	EUR	1.288.000		
EUR	700.000				IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3.75% 15/01/2028	1.135.587	0,28
	ZF Finance GmbH 3.75% 21/09/2028	626.594	0,16	EUR	471.000		
	Deutschland, insgesamt	38.977.241	9,67		International Design Group SpA 6.50% 15/11/2025	454.774	0,11
GIBRALTAR				EUR	832.000		
EUR	1.066.000				Lottomatica SpA 5.13% 15/07/2025	822.285	0,20
	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	907.516	0,23	EUR	522.000		
	Gibraltar, insgesamt	907.516	0,23		Lottomatica SpA 6.25% 15/07/2025	521.681	0,13
GRIECHENLAND				EUR	805.000		
EUR	450.000				Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	855.591	0,21
	Eurobank SA FRN 05/05/2027	377.392	0,09	EUR	303.000		
EUR	1.846.000				Marcolin SpA 6.13% 15/11/2026	256.583	0,06
	Eurobank SA FRN 26/01/2029	1.799.580	0,45	EUR	935.000		
EUR	1.050.000				Mundys SpA 1.63% 03/02/2025	886.233	0,22
	National Bank of Greece SA FRN 22/11/2027	1.060.140	0,26	EUR	625.000		
	Griechenland, insgesamt	3.237.112	0,80	EUR	3.174.000		
					Mundys SpA 1.88% 12/02/2028	526.460	0,13
IRLAND				EUR	3.174.000		
EUR	4.471.000				Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	2.888.961	0,72
	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	4.247.768	1,05	EUR	1.042.000		
GBP	1.258.000				Nexi SpA 2.13% 30/04/2029	857.904	0,21
	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 4.88% 15/07/2028	1.223.116	0,30	EUR	1.520.000		
	Irland, insgesamt	5.470.884	1,35		Telecom Italia SpA 2.38% 12/10/2027	1.315.713	0,33
INSEL MAN				EUR	2.412.000		
EUR	440.755				Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	2.306.839	0,57
	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	439.519	0,11	EUR	375.000		
EUR	119.000				Telecom Italia SpA 2.88% 28/01/2026	351.042	0,09
	Playtech plc 4.25% 07/03/2026	114.722	0,03	EUR	920.000		
	Insel Man, insgesamt	554.241	0,14		Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	883.536	0,22
ITALIEN				EUR	1.175.000		
EUR	1.035.000				Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	1.167.131	0,29
	Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 26/06/2026	957.509	0,24	EUR	600.000		
EUR	1.468.000				Telecom Italia SpA 5.25% 17/03/2055	491.040	0,12
	Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 01/02/2027	1.337.308	0,33	GBP	1.000.000		
EUR	633.000				Telecom Italia SpA 5.88% 19/05/2023	1.137.645	0,28
	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	549.011	0,14	EUR	1.332.000		
EUR	609.000				Telecom Italia SpA 6.88% 15/02/2028	1.362.920	0,34
	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	522.668	0,13		Italien, insgesamt	25.495.318	6,32
				JERSEY - KANALINSELN			
				EUR	175.757		
					Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	175.369	0,04
				EUR	3.023.000		
					Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	2.954.118	0,72
				EUR	849.000		
					Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	786.740	0,20

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
JERSEY - KANALINSELN (Fortsetzung)				LUXEMBURG (Fortsetzung)			
GBP	1.418.000 Kane Bidco Limited 6.50% 15/02/2027	1.449.170	0,36	EUR	960.000 Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	893.007	0,22
	Jersey - Kanalinseln, insgesamt	5.365.397	1,32	EUR	1.110.000 Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	1.191.004	0,30
LUXEMBURG				EUR	2.700.000 Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	2.474.058	0,62
EUR	912.000 Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	860.338	0,21	Luxemburg, insgesamt			
EUR	1.598.000 Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	1.277.902	0,32	27.023.429			
EUR	117.000 Altice Financing SA 4.25% 15/08/2029	94.477	0,02	6,73			
EUR	2.200.000 Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	1.659.963	0,42	NIEDERLANDE			
EUR	3.962.000 Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	2.974.451	0,74	EUR	1.400.000 Abertis Infraestructuras Finance BV - Perp FRN	1.140.837	0,28
GBP	564.000 B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	604.444	0,15	EUR	2.493.000 Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	2.151.475	0,54
EUR	1.395.000 Canpack SA 2.38% 01/11/2027	1.140.591	0,28	EUR	848.000 Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/01/2025	839.454	0,21
EUR	257.000 Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	249.103	0,06	EUR	100.000 Constellium SE 4.25% 15/02/2026	97.670	0,02
EUR	370.437 Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	370.402	0,09	EUR	2.436.000 Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	2.370.606	0,59
EUR	989.000 Cirsa Finance International Sarl 10.38% 30/11/2027	1.052.052	0,26	EUR	1.762.000 Dufry One BV 2.00% 15/02/2027	1.525.960	0,38
EUR	443.000 CPI Property Group SA Perp FRN	189.538	0,05	EUR	200.000 Dufry One BV 2.50% 15/10/2024	196.949	0,05
EUR	430.000 Eurofins Scientific SE FRN 13/11/2166	397.290	0,10	EUR	472.000 Dufry One BV 3.38% 15/04/2028	416.211	0,10
EUR	871.000 Eurofins Scientific SE FRN 24/07/2171	866.973	0,22	EUR	128.000 Goodyear Europe BV 2.75% 15/08/2028	104.614	0,03
EUR	1.073.953 Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	1.043.610	0,26	EUR	1.107.000 LKQ European Holdings BV 4.13% 01/04/2028	1.073.315	0,27
EUR	539.000 Garfunkelux Holdco 3 SA 6.75% 01/11/2025	415.192	0,10	EUR	400.000 Naturgy Finance BV FRN 29/12/2049	387.896	0,10
GBP	960.000 Garfunkelux Holdco 3 SA 7.75% 01/11/2025	832.224	0,21	EUR	1.000.000 Naturgy Finance BV - Perp FRN	872.209	0,22
EUR	4.924.000 InPost SA 2.25% 15/07/2027	4.200.766	1,04	EUR	1.426.000 Nobel Bidco BV 3.13% 15/06/2028	1.010.924	0,25
EUR	770.431 LHMC Finco 2 Sarl 7.25% 02/10/2025	713.441	0,18	EUR	1.720.000 OI European Group BV 2.88% 15/02/2025	1.676.810	0,42
EUR	102.423 LHMC Finco 2 Sarl 7.25% 02/10/2025	94.847	0,02	EUR	200.000 Phoenix Pib Dutch Finance BV 2.38% 05/08/2025	190.565	0,05
EUR	1.176.395 Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	1.170.830	0,29	EUR	624.000 Ppf Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	590.536	0,15
EUR	1.233.000 Loarre Investments Sarl 6.50% 15/05/2029	1.150.870	0,29	EUR	500.000 PPF Telecom Group BV 3.13% 27/03/2026	469.673	0,12
EUR	490.000 Loarre Investments Sarl FRN 15/05/2029	472.842	0,12	EUR	459.000 PPF Telecom Group BV 3.25% 29/09/2027	422.224	0,10
EUR	684.000 Matterhorn Telecom SA 4.00% 15/11/2027	633.214	0,16	EUR	612.000 PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	603.770	0,15
				EUR	622.000 Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	574.534	0,14
				EUR	2.174.000 Repsol International Finance BV FRN 22/03/2170	1.896.563	0,48
				EUR	907.000 Repsol International Finance BV FRN 11/06/2169	856.479	0,21

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
NIEDERLANDE (Fortsetzung)				NIEDERLANDE (Fortsetzung)					
EUR	462.000	Repsol International Finance BV FRN 11/06/2169	436.266	0,11	EUR	214.000	United Group BV 5.25% 01/02/2030	152.649	0,04
EUR	843.000	Repsol International Finance BV FRN 31/12/2049	758.992	0,19	EUR	974.000	Villa Dutch Bidco BV 9.00% 03/11/2029	923.427	0,23
EUR	1.061.305	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	832.735	0,21	EUR	1.379.000	VZ Secured Financing BV 3.50% 15/01/2032	1.103.733	0,27
EUR	999.395	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	784.158	0,19	EUR	1.119.000	VZ Vendor Financing II BV 2.88% 15/01/2029	896.793	0,22
EUR	1.000.000	Telefonica Europe BV FRN 24/09/2170	851.453	0,21	EUR	1.300.000	ZF Europe Finance BV 2.00% 23/02/2026	1.186.868	0,29
EUR	1.600.000	Telefonica Europe BV FRN 24/05/2170	1.333.326	0,33	Niederlande, insgesamt		49.038.170	12,19	
EUR	300.000	Telefonica Europe BV FRN 03/05/2171	290.322	0,07	PORTUGAL				
EUR	400.000	Telefonica Europe BV FRN 23/11/2171	408.091	0,10	EUR	700.000	Edp - Energias de Portugal SA FRN 20/07/2080	634.661	0,16
EUR	3.700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	3.427.880	0,85	EUR	1.400.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 14/03/2082	1.178.196	0,29
EUR	2.900.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	2.837.211	0,70	EUR	2.300.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 23/04/2083	2.260.007	0,56
EUR	2.198.000	Tennet Holding BV FRN 22/10/2168	2.053.385	0,51	Portugal, insgesamt		4.072.864	1,01	
EUR	495.000	TenneT Holding BV Perp FRN	487.052	0,12	RUMÄNIEN				
EUR	589.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.63% 15/10/2028	458.056	0,11	EUR	1.600.000	RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	1.513.283	0,38
EUR	525.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.88% 31/03/2027	445.260	0,11	EUR	400.000	RCS & RDS SA 3.25% 05/02/2028	338.060	0,08
EUR	2.270.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.75% 09/05/2027	2.058.456	0,51	Rumänien, insgesamt		1.851.343	0,46	
EUR	1.413.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.38% 09/05/2030	1.199.633	0,30	SPANIEN				
EUR	1.499.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	1.482.219	0,37	EUR	1.100.000	Banco de SAbadell SA FRN 07/02/2029	1.043.820	0,26
EUR	1.058.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7.38% 15/09/2029	1.074.274	0,27	EUR	1.800.000	Cellnex Finance Company SA 1.00% 15/09/2027	1.539.436	0,38
EUR	231.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7.88% 15/09/2031	238.879	0,06	EUR	2.500.000	Cellnex Finance Company SA 1.25% 15/01/2029	2.046.363	0,51
EUR	1.214.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	1.123.763	0,28	EUR	1.800.000	Cellnex Finance Company SA 1.50% 08/06/2028	1.536.376	0,38
EUR	2.228.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	1.842.953	0,46	EUR	1.200.000	Cellnex Finance Company SA 2.00% 15/02/2033	921.342	0,23
EUR	346.000	United Group BV 4.63% 15/08/2028	256.639	0,06	EUR	900.000	Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	846.804	0,21
EUR	641.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	624.423	0,16	EUR	1.100.000	Cellnex Telecom SA 1.00% 20/04/2027	964.671	0,24
					EUR	2.000.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	1.667.193	0,42
					EUR	600.000	Cellnex Telecom SA 2.88% 18/04/2025	588.087	0,15

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Anleihen (Fortsetzung)				
SPANIEN (Fortsetzung)					VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				
EUR	2.558.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	2.002.104	0,50	EUR	1.565.000	BCP V Modular Services Finance II plc 4.75% 30/11/2028	1.333.598	0,33
EUR	1.085.000	Grifols SA 1.63% 15/02/2025	1.023.996	0,25	GBP	410.000	Bellis Acquisition Company plc 4.50% 16/02/2026	395.724	0,10
EUR	2.011.000	Grifols SA 2.25% 15/11/2027	1.712.352	0,43	GBP	1.676.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	1.246.388	0,31
EUR	1.586.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	1.447.118	0,36	EUR	1.101.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	1.020.805	0,25
EUR	400.000	International Consolidated Airlines Group SA 2.75% 25/03/2025	382.490	0,09	EUR	686.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	599.220	0,15
EUR	967.000	Kaixo Bondco Telecom SA 5.13% 30/09/2029	851.352	0,21	GBP	510.000	Centrica plc FRN 10/04/2075	548.682	0,14
EUR	4.228.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	3.892.824	0,97	GBP	1.029.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	1.099.324	0,27
		Spanien, insgesamt	22.466.328	5,59	GBP	100.000	Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	112.998	0,03
SCHWEDEN					GBP	937.000	Co-Operative Group Limited FRN 08/07/2026	992.879	0,25
EUR	1.540.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2169	792.425	0,20	GBP	1.623.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	1.542.653	0,39
EUR	932.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2170	479.571	0,12	EUR	1.371.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	1.267.215	0,31
EUR	530.000	Heimstaden Bostad AB FRN 19/02/2168	328.209	0,08	EUR	454.000	INEOS Finance plc 2.13% 15/11/2025	426.862	0,11
EUR	1.420.000	Heimstaden Bostad AB FRN 15/04/2169	756.025	0,19	EUR	2.200.000	INEOS Finance plc 2.88% 01/05/2026	2.051.726	0,51
EUR	866.608	Intrum AB 3.13% 15/07/2024	834.168	0,21	EUR	577.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	541.363	0,13
EUR	1.720.000	Intrum AB 3.50% 15/07/2026	1.435.500	0,36	EUR	396.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	371.542	0,09
EUR	2.044.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	1.894.138	0,46	EUR	1.003.000	INEOS Finance plc 6.63% 15/05/2028	1.012.941	0,25
EUR	1.190.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB - Perp FRN	441.134	0,11	EUR	904.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	813.666	0,20
EUR	1.775.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	1.578.593	0,39	EUR	2.074.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	1.866.750	0,46
EUR	798.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	709.700	0,18	GBP	981.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	1.062.669	0,26
EUR	486.000	Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	452.263	0,11	EUR	1.592.000	International Game Technology plc 2.38% 15/04/2028	1.407.450	0,35
EUR	305.000	Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	305.938	0,08	EUR	120.666	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	120.088	0,03
EUR	583.000	Verisure Holding AB 9.25% 15/10/2027	627.063	0,16	EUR	2.677.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	2.589.990	0,64
EUR	1.932.000	Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	1.609.799	0,40	GBP	1.538.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	1.662.826	0,41
EUR	628.000	Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	523.268	0,13	EUR	320.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.20% 15/01/2024	313.257	0,08
		Schweden, insgesamt	12.767.794	3,18	EUR	102.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 4.50% 15/07/2028	83.910	0,02
VEREINIGTES KÖNIGREICH									
GBP	340.000	Barclays plc FRN 14/11/2032	400.224	0,10					
GBP	523.000	Barclays plc FRN 15/06/2171	540.050	0,13					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					
EUR	1.068.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	1.051.286	0,26	EUR	2.316.000	Vodafone Group plc FRN 03/01/2079	2.284.969	0,57
EUR	2.587.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	2.477.512	0,61	EUR	2.629.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	2.405.822	0,60
GBP	578.000	Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	569.930	0,14	GBP	335.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	363.446	0,09
GBP	1.481.000	Jerrold Finco plc 5.25% 15/01/2027	1.422.118	0,35	USD	1.727.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	1.556.168	0,39
GBP	1.617.000	Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 08/09/2023	1.831.335	0,45	GBP	3.131.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	2.695.844	0,67
GBP	1.245.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	1.283.429	0,32	Vereinigtes Königreich, insgesamt			66.518.018	16,50
GBP	490.000	Marks & Spencer plc 6.00% 12/06/2025	551.475	0,14	VEREINIGTE STAATEN				
GBP	435.000	NatWest Markets plc 6.38% 08/11/2027	514.981	0,13	EUR	1.576.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	1.305.121	0,32
EUR	1.280.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	1.187.145	0,29	EUR	333.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3.00% 01/09/2029	248.595	0,06
GBP	1.333.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	1.404.817	0,35	EUR	2.488.000	Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	2.400.546	0,60
GBP	850.000	Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	878.871	0,22	EUR	150.000	Avantor Funding Inc. 3.88% 15/07/2028	140.313	0,03
GBP	333.000	Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	331.633	0,08	EUR	2.106.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	1.899.805	0,47
EUR	895.000	Rolls-Royce plc 1.63% 09/05/2028	744.498	0,18	EUR	535.000	Ford Motor Credit Company LLC 1.74% 19/07/2024	513.963	0,13
GBP	730.000	Rolls-Royce plc 3.38% 18/06/2026	756.394	0,19	EUR	2.138.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.33% 25/11/2025	1.994.881	0,50
GBP	2.263.000	Rolls-Royce plc 5.75% 15/10/2027	2.465.299	0,61	EUR	271.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	252.852	0,06
GBP	1.377.000	Santander UK plc Perp 10.06%	2.272.974	0,56	EUR	291.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	271.513	0,07
EUR	1.616.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	1.393.845	0,35	GBP	1.543.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	1.673.956	0,42
EUR	2.098.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	1.930.868	0,48	EUR	440.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	433.096	0,11
EUR	931.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	755.061	0,19	EUR	1.697.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	1.630.228	0,40
EUR	886.000	Victoria plc 3.75% 15/03/2028	698.585	0,17	EUR	715.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	686.867	0,17
GBP	988.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.13% 15/08/2030	916.616	0,23	GBP	1.055.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	1.154.331	0,29
GBP	603.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.25% 15/01/2030	559.901	0,14	EUR	2.646.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.87% 03/08/2027	2.568.339	0,63
GBP	969.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.00% 15/04/2027	1.036.341	0,26	GBP	1.405.000	Ford Motor Credit Company LLC 6.86% 05/06/2026	1.597.410	0,40
GBP	1.062.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	1.056.036	0,26	EUR	3.334.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	2.966.015	0,74
EUR	1.964.000	Vmed O2 UK Financing I plc 3.25% 31/01/2031	1.607.554	0,40	EUR	599.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/03/2029	511.731	0,13
GBP	1.324.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.50% 15/07/2031	1.205.587	0,30					
EUR	979.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	882.878	0,22					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					
EUR	552.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/03/2029	471.578	0,12	USD	602.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	622.086	0,15
EUR	1.340.000	IQVIA Inc. 2.88% 15/06/2028	1.207.000	0,29					
GBP	730.000	MPT Operating Partnership LP 2.50% 24/03/2026	621.792	0,15					
GBP	720.000	MPT Operating Partnership LP 2.55% 05/12/2023	779.870	0,20					
GBP	648.000	MPT Operating Partnership LP 3.69% 05/06/2028	487.489	0,12					
EUR	488.000	Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	484.557	0,12					
EUR	666.000	Netflix Inc. 4.63% 15/05/2029	680.838	0,17					
USD	525.000	Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	489.545	0,12					
USD	452.000	Occidental Petroleum Corp. 6.38% 01/09/2028	433.015	0,11					
USD	912.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	887.149	0,22					
USD	391.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	395.202	0,10					
USD	1.070.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	1.146.745	0,28					
EUR	1.070.000	Olympus Water USA Holding Corp. 3.88% 01/10/2028	873.888	0,22					
EUR	516.000	Olympus Water USA Holding Corp. 5.38% 01/10/2029	379.589	0,09					
EUR	832.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	786.815	0,20					
EUR	600.000	ZF North America Capital 2.75% 27/04/2023	599.549	0,15					
		Vereinigte Staaten, insgesamt	32.974.183	8,19					
		Anleihen, insgesamt	375.589.126	93,26					
		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	375.589.126	93,26					
		Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere							
		Anleihen							
		VEREINIGTE STAATEN							
USD	227.000	Occidental Petroleum Corp. 6.95% 01/07/2024	211.680	0,05					
		Vereinigte Staaten, insgesamt							
		Anleihen, insgesamt							
		Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt							
		VEREINIGTES KÖNIGREICH							
EUR	6.900.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	759.000	0,19					
EUR	1.000.000	Banco Espirito Santo SA 2.63% 31/12/2049**	110.000	0,03					
EUR	1.400.000	Banco Espirito Santo SA 4.75% 15/01/2024**	154.000	0,04					
		Portugal, insgesamt	1.023.000	0,26					
		VEREINIGTES KÖNIGREICH							
EUR	644.000	BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30/11/2029	516.088	0,13					
GBP	3.334.000	Bellis Acquisition Company plc 3.25% 16/02/2026	3.120.607	0,76					
GBP	4.139.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	4.420.034	1,11					
GBP	297.000	Pinewood Finance Company Limited 3.63% 15/11/2027	301.394	0,07					
GBP	1.093.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	1.041.868	0,26					
		Vereinigtes Königreich, insgesamt	9.399.991	2,33					
		Anleihen, insgesamt	10.422.991	2,59					
		Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt	10.422.991	2,59					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Fonds			
IRLAND			
76.636	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	7.575.412	1,88
3.803	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	4.329	0,00
4.597	Insight Liquidity Funds plc	5.232	0,00
	Irland, insgesamt	7.584.973	1,88
	Fonds, insgesamt	7.584.973	1,88
	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt	7.584.973	1,88
	Wert der Anlagen, insgesamt	394.430.856	97,93
	(Gesamtkosten: EUR 431.319.513)		

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

**Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)						
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)						
BELGIEN				DEUTSCHLAND						
EUR	200.000	Azelis Finance NV 5.75% 15/03/2028	203.000	0,29	EUR	453.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	419.247	0,60	
Belgien, insgesamt				203.000	0,29	EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.00% 14/07/2024	194.119	0,28
FINNLAND						EUR	400.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	385.952	0,55
EUR	400.000	Teollisuuden Voima Oyj 1.13% 09/03/2026	364.307	0,52	EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	271.219	0,39	
EUR	540.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.13% 04/02/2025	520.962	0,74	EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	280.193	0,40	
Finnland, insgesamt				885.269	1,26	EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	186.795	0,27
FRANKREICH						EUR	1.026.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	971.209	1,39
EUR	316.000	Altice France SA 2.13% 15/02/2025	292.741	0,42	EUR	499.000	HT Troplast GmbH 9.25% 15/07/2025	495.289	0,71	
EUR	1.256.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	1.173.323	1,68	EUR	684.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.63% 15/05/2025	682.256	0,97	
EUR	391.000	Banjay Entertainment SASU 3.50% 01/03/2025	381.210	0,54	EUR	200.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.88% 15/05/2027	176.320	0,25	
EUR	300.000	Casino Guichard Perrachon SA 3.58% 07/02/2025	92.263	0,13	EUR	180.000	IHO Verwaltungs GmbH 8.75% 15/05/2028	184.585	0,26	
EUR	200.000	Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026	192.119	0,27	EUR	529.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	459.717	0,66	
EUR	100.000	Crown European Holdings SA 3.38% 15/05/2025	98.583	0,14	EUR	600.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	583.172	0,83	
EUR	300.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	263.453	0,38	EUR	146.000	SGL Carbon SE 4.63% 30/09/2024	145.615	0,21	
EUR	100.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	94.572	0,14	EUR	530.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 2.00% 15/07/2025	495.048	0,71	
EUR	500.000	Elis SA 2.88% 15/02/2026	484.572	0,69	EUR	500.000	TUI Cruises GmbH 6.50% 15/05/2026	450.217	0,64	
EUR	260.000	Emeria SASU 7.75% 31/03/2028	247.395	0,35	EUR	100.000	ZF Finance GmbH 3.00% 21/09/2025	95.306	0,14	
EUR	102.000	Faurecia SE 2.63% 15/06/2025	97.948	0,14	Deutschland, insgesamt					
EUR	1.091.000	Faurecia SE 2.63% 15/06/2025	1.047.663	1,50	6.476.259	9,26				
EUR	250.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	222.900	0,32	GIBRALTAR					
EUR	1.028.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	999.548	1,43	EUR	340.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	289.452	0,41	
EUR	1.356.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	1.309.330	1,87	Gibraltar, insgesamt					
EUR	100.000	iliad SA 5.38% 14/06/2027	99.391	0,14	289.452	0,41				
EUR	100.000	iliad SA 0.75% 11/02/2024	97.274	0,14	IRLAND					
EUR	381.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	371.378	0,53	EUR	416.000	Eircom Finance Dac 1.75% 01/11/2024	410.106	0,59	
EUR	177.178	Loxam SAS 6.00% 15/04/2025	171.243	0,24	EUR	744.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	706.853	1,01	
EUR	820.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	812.251	1,16	Irland, insgesamt					
EUR	713.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	719.342	1,03	1.116.959	1,60				
EUR	174.000	Tereos Finance Groupe I SA 7.25% 15/04/2028	171.078	0,24	Frankreich, insgesamt					
EUR	300.000	Valeo 3.25% 22/01/2024	298.254	0,43	10.136.647	14,48				
EUR	400.000	Valeo 5.38% 28/05/2027	398.816	0,57						

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
INSEL MAN				LUXEMBURG					
EUR	368.302	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	367.269	0,53	EUR	750.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	707.515	1,01
EUR	110.000	Playtech plc 4.25% 07/03/2026	106.046	0,15	GBP	837.000	B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	897.021	1,29
		Insel Man, insgesamt	473.315	0,68	EUR	800.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	654.102	0,93
ITALIEN				MEXIKO					
EUR	325.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.38% 16/09/2025	326.810	0,47	EUR	100.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	96.927	0,14
EUR	419.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	374.272	0,53	EUR	150.588	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	150.574	0,22
EUR	300.000	International Design Group SpA 6.50% 15/11/2025	289.665	0,41	EUR	214.000	Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	207.954	0,30
EUR	686.000	Lottomatica SpA 5.13% 15/07/2025	677.990	0,97	EUR	200.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 6.75% 01/11/2025	154.060	0,22
EUR	578.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	526.092	0,75	GBP	143.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.75% 01/11/2025	123.967	0,18
EUR	681.000	Rossini Sarl 6.75% 30/10/2025	684.455	0,98	EUR	493.000	HSE Finance Sarl 5.63% 15/10/2026	249.483	0,36
EUR	277.000	Telecom Italia SpA 2.50% 19/07/2023	275.576	0,39	EUR	611.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	521.257	0,74
EUR	100.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	95.640	0,14	EUR	171.671	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	170.859	0,24
EUR	185.000	Telecom Italia SpA 2.88% 28/01/2026	173.181	0,25	EUR	800.000	Matterhorn Telecom SA 2.63% 15/09/2024	793.165	1,13
EUR	300.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	297.991	0,43	EUR	280.000	Matterhorn Telecom SA 3.13% 15/09/2026	259.978	0,37
EUR	115.000	Telecom Italia SpA 6.88% 15/02/2028	117.669	0,17	EUR	375.000	PLT VII Finance Sarl 4.63% 05/01/2026	352.415	0,50
		Italien, insgesamt	3.839.341	5,49	EUR	100.000	PLT VII Finance Sarl 4.63% 05/01/2026	93.977	0,13
JAPAN				MEXIKO					
EUR	130.000	SoftBank Group Corp 4.00% 20/04/2023	129.977	0,19	EUR	222.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	206.508	0,29
EUR	300.000	SoftBank Group Corp. 2.13% 06/07/2024	284.918	0,41			Luxemburg, insgesamt	5.639.762	8,05
		Japan, insgesamt	414.895	0,60	EUR	247.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 21/02/2024	243.357	0,35
JERSEY - KANALINSELN				NIEDERLANDE					
EUR	111.642	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	111.395	0,16	EUR	350.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/01/2025	346.473	0,49
EUR	344.000	Avis Budget Finance plc 4.13% 15/11/2024	342.925	0,49	EUR	610.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	595.785	0,85
EUR	370.000	Avis Budget Finance plc 4.50% 15/05/2025	364.937	0,52	EUR	775.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	754.196	1,07
EUR	233.000	Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	215.913	0,31	EUR	327.273	Kongsberg Actuation Systems BV 5.00% 15/07/2025	312.083	0,45
GBP	162.000	Kane Bidco Limited 6.50% 15/02/2027	165.561	0,24	EUR	353.000	OI European Group BV 2.88% 15/02/2025	344.136	0,49
		Jersey - Kanalinseln, insgesamt	1.200.731	1,72			Mexiko, insgesamt	243.357	0,35

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
NIEDERLANDE (Fortsetzung)				SPANIEN (Fortsetzung)					
EUR	485.000	OI European Group BV 3.13% 15/11/2024	475.597	0,68	EUR	300.000	International Consolidated Airlines Group SA 0.50% 04/07/2023	297.224	0,42
EUR	475.000	PPF Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	449.527	0,64	EUR	300.000	International Consolidated Airlines Group SA 2.75% 25/03/2025	286.868	0,41
EUR	468.000	PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	461.706	0,66	EUR	600.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	552.435	0,79
EUR	246.000	Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	227.227	0,32	Spanien, insgesamt			4.668.171	6,66
EUR	141.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	139.422	0,20	SCHWEDEN				
EUR	340.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	314.728	0,45	EUR	65.660	Intrum AB 3.13% 15/07/2024	63.202	0,09
EUR	650.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	537.665	0,76	EUR	777.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	720.031	1,03
EUR	440.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	428.621	0,61	EUR	473.000	Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	440.166	0,63
EUR	300.000	ZF Europe Finance BV 2.00% 23/02/2026	273.893	0,39	EUR	100.000	Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	100.308	0,14
Niederlande, insgesamt			5.661.059	8,06	EUR	280.000	Verisure Holding AB 9.25% 15/10/2027	301.163	0,43
				Schweden, insgesamt				1.624.870	2,32
PANAMA				VEREINIGTES KÖNIGREICH					
EUR	100.000	Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	89.590	0,13	GBP	306.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	227.562	0,33
EUR	212.000	Carnival Corp. 10.13% 01/02/2026	223.524	0,32	GBP	145.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	154.910	0,22
Panama, insgesamt			313.114	0,45	GBP	145.000	Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	163.847	0,23
RUMÄNIEN				GBP 124.000 Co-Operative Group Limited FRN 08/07/2026				131.395	0,19
EUR	600.000	RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	567.481	0,81	EUR	489.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	451.983	0,65
Rumänien, insgesamt			567.481	0,81	EUR	365.000	EG Global Finance plc 3.63% 07/02/2024	358.417	0,51
SPANIEN				EUR 100.000 INEOS Finance plc 2.13% 15/11/2025				94.022	0,13
EUR	400.000	Banco de SAbadell SA FRN 24/03/2026	376.053	0,54	EUR	1.153.000	INEOS Finance plc 2.88% 01/05/2026	1.075.291	1,54
EUR	600.000	Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	564.536	0,81	EUR	300.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	281.471	0,40
EUR	300.000	Cellnex Telecom SA 2.88% 18/04/2025	294.044	0,42	EUR	482.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	433.835	0,62
EUR	545.000	Gestamp Automocion SA 3.25% 30/04/2026	520.645	0,74	EUR	394.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	354.629	0,51
EUR	100.000	Grifols SA 1.63% 15/02/2025	94.378	0,13	GBP	247.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	267.563	0,38
EUR	1.383.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	1.261.894	1,80	EUR	77.092	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	76.723	0,11
EUR	500.000	Grupo Antolin-Irausa SA 3.38% 30/04/2026	420.094	0,60					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)						
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)						
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
EUR	1.090.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	1.054.572	1,51	GBP	270.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	295.421	0,42	
GBP	900.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	973.045	1,39	EUR	418.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.87% 03/08/2027	405.733	0,58	
EUR	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.20% 15/01/2024	97.893	0,14	EUR	464.000	IQVIA Inc. 1.75% 15/03/2026	433.383	0,62	
EUR	240.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	236.244	0,34	EUR	750.000	IQVIA Inc. 2.88% 15/09/2025	737.981	1,05	
EUR	413.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	395.521	0,56	GBP	657.000	MPT Operating Partnership LP 2.55% 05/12/2023	711.631	1,02	
GBP	543.000	Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	535.418	0,76	EUR	175.000	Netflix Inc. 3.00% 15/06/2025	172.319	0,25	
GBP	835.000	Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 08/09/2023	945.680	1,35	USD	260.000	Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	242.441	0,35	
GBP	200.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	206.173	0,29	EUR	1.380.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	1.347.822	1,94	
EUR	404.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	374.692	0,54	EUR	400.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	378.276	0,54	
GBP	300.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	316.163	0,45	EUR	1.000.000	ZF North America Capital 2.75% 27/04/2023	999.248	1,43	
GBP	400.000	Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	413.587	0,59	Vereinigte Staaten, insgesamt		7.487.574	10,72		
EUR	238.000	Rolls-Royce plc 0.88% 09/05/2024	229.303	0,33	Anleihen, insgesamt			64.052.546	91,51	
EUR	350.000	Rolls-Royce plc 4.63% 16/02/2026	347.244	0,49	Wandelanleihen					
EUR	482.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	415.739	0,59	FRANKREICH					
EUR	400.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	368.135	0,53	EUR	10.988	Elis SA 0.00% 06/10/2023	343.029	0,49	
EUR	975.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	790.746	1,13	Frankreich, insgesamt		343.029	0,49		
GBP	600.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.00% 15/04/2027	641.697	0,92	Wandelanleihen, insgesamt			343.029	0,49	
GBP	462.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	397.790	0,57	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt				64.395.575	92,00
Vereinigtes Königreich, insgesamt		12.811.290	18,30	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere						
VEREINIGTE STAATEN				Anleihen						
EUR	857.000	Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	826.876	1,18	VEREINIGTE STAATEN					
EUR	290.000	Ball Corp. 0.88% 15/03/2024	282.721	0,40	USD	122.000	Occidental Petroleum Corp. 6.95% 01/07/2024	113.766	0,16	
EUR	200.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.33% 25/11/2025	186.612	0,27	Vereinigte Staaten, insgesamt		113.766	0,16		
GBP	191.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	207.210	0,30	Anleihen, insgesamt			113.766	0,16	
EUR	144.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	141.740	0,20	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt				113.766	0,16
EUR	123.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	118.160	0,17						

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				
Anleihen				
VEREINIGTES KÖNIGREICH				
GBP	520.000	Bellis Acquisition Company plc 3.25% 16/02/2026	486.717	0,70
GBP	1.405.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	1.500.398	2,14
GBP	178.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	169.673	0,24
GBP	267.000	Talktalk Telecom Group plc 3.88% 20/02/2025	254.077	0,36
		Vereinigtes Königreich, insgesamt	2.410.865	3,44
		Anleihen, insgesamt	2.410.865	3,44
		Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt	2.410.865	3,44
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren				
Fonds				
IRLAND				
	162	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	16.045	0,02
		Irland, insgesamt	16.045	0,02
		Fonds, insgesamt	16.045	0,02
		Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt	16.045	0,02
		Wert der Anlagen, insgesamt	66.936.251	95,62

(Gesamtkosten: EUR 70.953.282)

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
ÖSTERREICH				FRANKREICH (Fortsetzung)					
EUR	400.000	Erste Group Bank AG 0.13% 17/05/2028	326.458	0,09	EUR	1.600.000	CNP Assurances FRN 18/07/2053	1.548.980	0,44
EUR	100.000	Erste Group Bank AG 0.13% 17/05/2028	81.614	0,02	EUR	9.500.000	Credit Agricole SA 0.13% 09/12/2027	8.033.738	2,27
EUR	2.800.000	Erste Group Bank AG FRN 16/01/2031	2.758.920	0,78	EUR	2.000.000	Credit Agricole SA FRN 21/09/2029	1.647.088	0,46
EUR	2.200.000	Telekom Finanzmanagement GmbH 1.50% 07/12/2026	2.047.713	0,58	EUR	2.600.000	Credit Mutuel Arkea SA 0.38% 03/10/2028	2.136.301	0,60
		Österreich, insgesamt	5.214.705	1,47	EUR	700.000	Credit Mutuel Arkea SA FRN 11/06/2029	601.956	0,17
BELGIEN					EUR	4.300.000	Danone SA 1.00% 26/03/2025	4.139.960	1,17
EUR	700.000	Bpost SA 1.25% 11/07/2026	650.294	0,18	EUR	700.000	Electricite de France SA 1.00% 29/11/2033	502.625	0,14
EUR	1.000.000	KBC Group NV FRN 16/06/2027	892.947	0,25	EUR	300.000	Electricite de France SA 1.00% 29/11/2033	215.411	0,06
EUR	900.000	VGP NV 1.63% 17/01/2027	700.477	0,20	EUR	1.200.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	978.514	0,28
		Belgien, insgesamt	2.243.718	0,63	EUR	675.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	656.318	0,19
DÄNEMARK					EUR	800.000	Ile-de-France Mobilites 0.40% 28/05/2031	649.289	0,18
EUR	5.471.000	Danske Bank AS FRN 10/01/2031	5.498.088	1,55	EUR	3.400.000	La Banque Postale SA 0.75% 23/06/2031	2.588.961	0,73
EUR	550.000	Nykredit Realkredit AS 0.38% 17/01/2028	458.186	0,13	EUR	800.000	La Poste SA 1.38% 21/04/2032	658.463	0,19
EUR	700.000	Orsted A/S FRN 24/11/3017	665.068	0,19	EUR	3.700.000	Orange SA 0.13% 16/09/2029	2.988.055	0,84
		Dänemark, insgesamt	6.621.342	1,87	EUR	300.000	Orange SA 0.13% 16/09/2029	242.275	0,07
FINNLAND					EUR	900.000	Orange SA 2.38% 18/05/2032	816.060	0,23
EUR	1.500.000	Elenia Verkko Oyj 0.38% 06/02/2027	1.310.847	0,37	EUR	400.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	396.220	0,11
EUR	900.000	OP Corporate Bank plc 0.38% 26/02/2024	873.863	0,25	EUR	800.000	Regie Autonome des Transports Parisiens 0.88% 25/05/2027	732.458	0,21
		Finnland, insgesamt	2.184.710	0,62	EUR	1.100.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0.75% 12/01/2034	833.363	0,23
FRANKREICH					EUR	700.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 1.88% 23/10/2037	557.645	0,16
EUR	1.400.000	AXA SA FRN 07/10/2041	1.054.066	0,30	EUR	2.800.000	Sanofi 1.50% 01/04/2030	2.510.660	0,71
EUR	2.700.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.00% 21/11/2029	2.756.018	0,78	EUR	1.600.000	Schneider Electric SE 1.84% 13/10/2025	1.533.985	0,43
EUR	2.000.000	BNP Paribas SA FRN 14/10/2027	1.752.547	0,49	EUR	200.000	SNCF Reseau 2.25% 20/12/2047	154.173	0,04
EUR	2.200.000	BNP Paribas SA 1.00% 17/04/2024	2.139.842	0,60	EUR	1.100.000	Societe du Grand Paris EPIC 1.63% 08/04/2042	794.591	0,22
EUR	2.400.000	BPCE SA 0.63% 26/09/2023	2.368.979	0,67	EUR	2.500.000	Societe Generale SA FRN 02/12/2027	2.165.831	0,61
EUR	2.400.000	BPCE SA FRN 02/02/2034	1.972.241	0,56	EUR	900.000	Societe Generale SA FRN 02/12/2027	779.699	0,22
EUR	2.400.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/11/2026	2.158.399	0,61	EUR	1.800.000	Suez SACA 4.63% 03/11/2028	1.852.208	0,52
EUR	1.500.000	Caisse des Depots et Consignations 0.01% 15/09/2025	1.392.566	0,39	EUR	1.500.000	Unedic Asseo 0.25% 25/11/2029	1.259.671	0,36
EUR	1.500.000	Caisse des Depots et Consignations 0.01% 01/06/2026	1.366.485	0,39			Frankreich, insgesamt	58.935.641	16,63

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
DEUTSCHLAND				DEUTSCHLAND (Fortsetzung)					
EUR	3.300.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	3.363.995	0,95	EUR	300.000	Vantage Towers AG 0.38% 31/03/2027	298.761	0,08
EUR	900.000	Bayerische Landesbodenkreditanstalt 0.25% 21/03/2036	630.725	0,18	EUR	900.000	Vantage Towers AG 0.75% 31/03/2030	896.263	0,26
EUR	1.100.000	Bayerische Landesbodenkreditanstalt 0.63% 22/11/2027	989.255	0,28	EUR	100.000	Vantage Towers AG 0.75% 31/03/2030	99.585	0,03
EUR	2.900.000	Commerzbank AG FRN 24/03/2026	2.669.007	0,75	EUR	2.600.000	Vonovia SE 1.38% 28/01/2026	2.355.823	0,65
EUR	1.500.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 0.35% 29/09/2031	1.187.205	0,33	EUR	3.900.000	Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	2.055.797	0,58
EUR	600.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 0.63% 08/12/2050	305.912	0,09	EUR	2.600.000	Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	2.217.763	0,63
EUR	2.700.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	2.533.886	0,71	EUR	1.100.000	Vonovia SE 4.75% 23/05/2027	1.076.499	0,30
EUR	2.000.000	Deutsche Bank AG FRN 23/02/2028	1.736.251	0,49			Deutschland, insgesamt	42.130.675	11,85
EUR	500.000	Deutsche Bank AG FRN 24/05/2028	453.981	0,13			IRLAND		
EUR	425.000	Deutsche Kreditbank AG 0.01% 07/11/2029	349.101	0,10	EUR	2.620.000	AIB Group plc FRN 04/04/2028	2.377.042	0,67
EUR	600.000	Deutsche Kreditbank AG 0.88% 02/10/2028	534.266	0,15	EUR	5.214.000	AIB Group plc FRN 23/07/2029	5.108.561	1,44
EUR	1.985.000	E.ON SE 0.60% 01/10/2032	1.506.724	0,42	EUR	1.000.000	Bank of Ireland Group plc FRN 10/05/2027	881.710	0,25
EUR	1.700.000	E.ON SE 0.35% 28/02/2030	1.356.247	0,38	EUR	3.183.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	2.736.691	0,77
EUR	915.000	E.ON SE 0.60% 01/10/2032	694.535	0,20	EUR	750.000	Bank of Ireland Group plc FRN 16/07/2028	752.229	0,21
EUR	2.000.000	E.ON SE 1.63% 29/03/2031	1.730.507	0,49	EUR	600.000	ESB Finance DAC 1.00% 19/07/2034	458.337	0,13
EUR	4.500.000	Eurogrid GmbH 1.11% 15/05/2032	3.669.940	1,02	EUR	1.250.000	Kerry Group Financial Services Unltd Company 0.88% 01/12/2031	992.994	0,28
EUR	600.000	Hamburger Hochbahn AG 0.13% 24/02/2031	473.654	0,13	EUR	800.000	Lunar Funding V for Swisscom AG 1.13% 12/10/2026	734.793	0,21
EUR	300.000	Hamburger Hochbahn AG 0.13% 24/02/2031	236.827	0,07			Irland, insgesamt	14.042.357	3,96
EUR	750.000	Mercedes-Benz Group AG 0.75% 10/09/2030	625.080	0,17			ITALIEN		
EUR	250.000	Mercedes-Benz Group AG 0.75% 10/09/2030	208.360	0,06	EUR	700.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	563.733	0,16
EUR	2.800.000	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG FRN 26/05/2041	2.103.444	0,59	EUR	700.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	563.733	0,16
EUR	1.000.000	NRW Bank 0.10% 09/07/2035	693.123	0,20	EUR	1.100.000	Assicurazioni Generali SpA 1.71% 30/06/2032	822.938	0,23
EUR	2.900.000	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 05/07/2025	2.767.219	0,78	EUR	400.000	Banco BPM SpA 0.88% 15/07/2026	355.518	0,10
EUR	1.900.000	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 05/07/2025	1.813.005	0,51	EUR	1.200.000	Ferrovie dello Stato Italiane SpA 1.13% 09/07/2026	1.113.749	0,31
EUR	500.000	Vantage Towers AG 0.38% 31/03/2027	497.935	0,14	EUR	1.300.000	Ferrovie dello Stato Italiane SpA 1.50% 27/06/2025	1.244.598	0,35
					EUR	2.450.000	Intesa Sanpaolo SpA 5.25% 13/01/2030	2.544.074	0,72
					EUR	1.800.000	Snam SpA 0.00% 07/12/2028	1.454.244	0,41
					EUR	1.800.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.38% 23/06/2029	1.478.826	0,42

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
ITALIEN (Fortsetzung)				NIEDERLANDE (Fortsetzung)					
EUR	400.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale FRN 09/02/2171	335.270	0,09	EUR	300.000	EnBW International Finance BV 1.88% 31/10/2033	250.903	0,07
EUR	200.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale FRN 09/02/2171	167.635	0,05	EUR	2.200.000	Enel Finance International NV 1.50% 21/07/2025	2.111.378	0,60
		Italien, insgesamt	10.644.318	3,00	EUR	1.775.000	Enexis Holding NV 0.38% 14/04/2033	1.322.493	0,37
LUXEMBURG				LUXEMBURG					
EUR	2.850.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	2.645.430	0,75	EUR	221.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	172.893	0,05
EUR	400.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 12/02/2036	284.546	0,08	EUR	1.029.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	805.007	0,23
EUR	2.150.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	1.345.535	0,38	EUR	1.597.000	GSK Consumer Healthcare Capital NL BV 1.75% 29/03/2030	1.401.216	0,40
EUR	600.000	CPI Property Group SA 1.75% 14/01/2030	345.058	0,10	GBP	3.300.000	ING Groep NV FRN 07/12/2028	3.079.660	0,87
EUR	900.000	CPI Property Group SA 2.75% 12/05/2026	715.886	0,20	EUR	1.900.000	ING Groep NV 2.50% 15/11/2030	1.729.942	0,49
EUR	1.259.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	946.873	0,27	EUR	600.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	528.578	0,15
EUR	241.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	181.252	0,05	EUR	100.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	88.096	0,02
EUR	4.600.000	Prologis International Funding II SA 1.63% 17/06/2032	3.433.248	0,97	EUR	250.000	Nederlandse Financierings- Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV 0.13% 03/04/2027	223.116	0,06
EUR	2.100.000	Prologis International Funding II SA 3.13% 01/06/2031	1.810.449	0,51	EUR	1.200.000	Rentokil Initial Finance BV 3.88% 27/06/2027	1.198.534	0,34
EUR	1.600.000	Segro Capital Sarl 0.50% 22/09/2031	1.089.248	0,31	EUR	900.000	Royal Schiphol Group NV 1.50% 05/11/2030	776.321	0,22
EUR	2.150.000	SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	1.976.122	0,56	EUR	300.000	Royal Schiphol Group NV 2.00% 06/04/2029	275.725	0,08
		Luxemburg, insgesamt	14.773.647	4,18	EUR	1.000.000	Stedin Holding NV 0.00% 16/11/2026	890.395	0,25
NIEDERLANDE				NIEDERLANDE					
EUR	1.029.000	Achmea BV 3.63% 29/11/2025	1.027.058	0,29	EUR	3.400.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	2.817.951	0,79
EUR	1.100.000	Allianz Finance II BV 0.00% 22/11/2026	987.468	0,28	EUR	364.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	306.472	0,09
EUR	2.600.000	Allianz Finance II BV 1.50% 15/01/2030	2.344.322	0,67	EUR	2.200.000	Swisscom Finance BV 0.38% 14/11/2028	1.861.382	0,52
EUR	800.000	Cooperatieve Rabobank UA 0.25% 30/10/2026	718.120	0,20	EUR	500.000	Tennet Holding BV 0.50% 30/11/2040	326.138	0,09
USD	550.000	Cooperatieve Rabobank UA 1.00% 24/09/2026	454.950	0,13	EUR	1.393.000	TenneT Holding BV 0.88% 16/06/2035	1.080.104	0,30
GBP	1.000.000	Cooperatieve Rabobank UA 4.63% 23/05/2029	1.041.304	0,29	EUR	1.160.000	TenneT Holding BV 3.88% 28/10/2028	1.188.823	0,34
EUR	1.450.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	1.132.266	0,32	EUR	1.100.000	TenneT Holding BV Perp FRN	1.082.337	0,30
EUR	3.290.000	Digital Intrepid Holding BV 0.63% 15/07/2031	2.273.497	0,64	EUR	4.000.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	3.004.297	0,85
USD	251.000	EDP Finance BV 6.30% 11/10/2027	241.247	0,07			Niederlande, insgesamt	36.741.993	10,37
NORWEGEN				NORWEGEN					
EUR	200.000	Avinor AS 0.75% 01/10/2030			EUR	200.000	Avinor AS 0.75% 01/10/2030	163.063	0,05
EUR	1.050.000	Avinor AS 0.75% 01/10/2030			EUR	1.050.000	Avinor AS 0.75% 01/10/2030	856.079	0,24

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
NORWEGEN (Fortsetzung)				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)			
EUR	1.850.000 Avinor AS 1.00% 29/04/2025	1.753.478	0,49	GBP	740.000 Cadent Finance plc 5.75% 14/03/2034	858.285	0,24
EUR	200.000 Avinor AS 1.25% 09/02/2027	183.081	0,05	GBP	200.000 Cardiff University 3.00% 07/12/2055	166.372	0,05
EUR	2.326.000 DNB Bank ASA FRN 21/09/2027	2.288.336	0,65	GBP	810.000 Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	865.357	0,24
	Norwegen, insgesamt	5.244.037	1,48	GBP	630.000 Ds Smith plc 2.88% 26/07/2029	618.066	0,17
				GBP	400.000 DWR Cymru Financing UK plc 2.38% 31/03/2034	339.250	0,10
PORTUGAL				GBP	300.000 Legal & General Group plc FRN 27/10/2045	333.382	0,09
EUR	700.000 Caixa Geral de Depositos SA FRN 31/10/2028	723.086	0,20	EUR	950.000 Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	800.587	0,23
	Portugal, insgesamt	723.086	0,20	EUR	3.800.000 Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	3.202.350	0,90
SPANIEN				EUR	3.000.000 Motability Operations Group plc 3.50% 17/07/2031	2.962.823	0,83
EUR	800.000 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.75% 04/06/2025	752.640	0,21	EUR	308.000 National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	302.087	0,09
EUR	1.000.000 Banco de Sabadell SA FRN 11/03/2027	903.286	0,25	EUR	1.167.000 National Grid plc 3.88% 16/01/2029	1.161.072	0,33
EUR	1.100.000 Banco Santander SA 1.13% 23/06/2027	984.331	0,28	EUR	300.000 Nationwide Building Society 2.00% 28/04/2027	278.463	0,08
EUR	4.200.000 CaixaBank SA FRN 21/01/2028	3.730.767	1,05	EUR	8.050.000 Natwest Group plc FRN 26/02/2030	6.469.674	1,83
EUR	1.000.000 CaixaBank SA FRN 26/05/2028	860.920	0,24	EUR	1.944.000 NatWest Group plc FRN 14/03/2028	1.967.532	0,55
EUR	1.700.000 Iberdrola Finanzas SA 1.38% 11/03/2032	1.461.968	0,41	GBP	900.000 Pearson Funding plc 3.75% 04/06/2030	921.034	0,26
EUR	1.600.000 Telefonica Emisiones SA 2.59% 25/05/2031	1.476.275	0,42	GBP	270.000 Platform HG Financing plc 1.93% 15/09/2041	201.320	0,06
	Spanien, insgesamt	10.170.187	2,86	GBP	400.000 RCB Bonds plc 3.50% 08/12/2031	387.270	0,11
SCHWEDEN				GBP	500.000 RL Finance Bonds No. 2 plc FRN 30/11/2043	563.379	0,16
EUR	1.500.000 Essity AB 1.13% 27/03/2024	1.464.887	0,41	GBP	500.000 Severn Trent Utilities Finance plc 2.00% 02/06/2040	358.072	0,10
EUR	100.000 Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	89.915	0,03	GBP	200.000 Stonewater Funding plc 1.63% 10/09/2036	155.592	0,04
EUR	500.000 Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	449.575	0,13	EUR	5.130.000 Thames Water Utilities Finance plc 4.38% 18/01/2031	5.136.431	1,45
	Schweden, insgesamt	2.004.377	0,57	GBP	200.000 University College London 1.63% 04/06/2061	117.569	0,03
SCHWEIZ				GBP	300.000 University of Southampton 2.25% 11/04/2057	203.073	0,06
EUR	1.000.000 Credit Suisse AG 0.45% 19/05/2025	908.495	0,26	USD	1.000.000 Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	901.082	0,25
	Schweiz, insgesamt	908.495	0,26				
VEREINIGTES KÖNIGREICH							
GBP	250.000 Aster Treasury plc 1.41% 27/01/2036	196.297	0,06				
EUR	2.100.000 AstraZeneca plc 0.38% 03/06/2029	1.753.489	0,49				
GBP	800.000 BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	875.126	0,25				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)						
Anleihen (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)						
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				FRANKREICH (Fortsetzung)						
EUR	8.450.000	WellCome Trust Limited 1.13% 21/01/2027	7.787.801	2,19	EUR	400.000	Agence France Locale 0.20% 20/03/2029	337.161	0,10	
GBP	1.600.000	Yorkshire Building Society FRN 11/10/2030	1.586.602	0,44	EUR	1.000.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/02/2028	865.980	0,24	
Vereinigtes Königreich, insgesamt				41.469.437	11,68	EUR	1.200.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/11/2030	957.563	0,27
VEREINIGTE STAATEN				FRANKREICH (Fortsetzung)						
EUR	292.000	Air Products and Chemicals Inc. 4.00% 03/03/2035	294.046	0,08	GBP	1.200.000	Caisse D'amortissement de la Dette Sociale 0.13% 15/12/2025	1.218.099	0,34	
USD	2.600.000	Roche Holdings Inc. 2.38% 28/01/2027	2.239.780	0,63	EUR	300.000	Caisse Francaise de Financement Local 0.01% 07/05/2025	279.883	0,08	
Vereinigte Staaten, insgesamt				2.533.826	0,71	EUR	1.100.000	Caisse Francaise de Financement Local 0.50% 19/02/2027	991.020	0,28
Anleihen, insgesamt				256.586.551	72,34	EUR	2.100.000	City of Paris 1.38% 20/11/2034	1.705.894	0,48
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)						
ÖSTERREICH				FRANKREICH (Fortsetzung)						
EUR	700.000	Oesterreichische Kontrollbank AG 0.00% 08/10/2026	629.493	0,18	EUR	400.000	France (Govt of) 1.75% 25/06/2039	333.088	0,09	
Österreich, insgesamt				629.493	0,18	EUR	1.200.000	Region Ile de France 0.00% 20/04/2028	1.031.406	0,29
BELGIEN				FRANKREICH (Fortsetzung)						
EUR	250.000	Belgium (Govt of) 1.25% 22/04/2033	214.516	0,06	EUR	700.000	Region of Ile de France 0.50% 14/06/2025	661.393	0,19	
EUR	2.400.000	Communaute Francaise de Belgique 0.63% 11/06/2035	1.726.956	0,49	EUR	400.000	Region of Ile de France 0.61% 02/07/2040	251.192	0,07	
EUR	1.400.000	Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 0.38% 15/04/2030	1.164.173	0,33	EUR	700.000	SNCF SA 1.00% 19/01/2061	296.525	0,08	
EUR	1.800.000	Region Wallonne 1.05% 22/06/2040	1.201.126	0,34	EUR	600.000	Societe du Grand Paris EPIC 0.00% 25/11/2030	473.813	0,13	
Belgien, insgesamt				4.306.771	1,22	EUR	100.000	Societe du Grand Paris EPIC 1.70% 25/05/2050	67.073	0,02
FINNLAND				FRANKREICH (Fortsetzung)						
EUR	1.700.000	Kuntarahoitus Oyj 0.05% 10/09/2035	1.171.158	0,33	EUR	3.000.000	Unedic Asseo 0.00% 25/11/2028	2.542.674	0,72	
Finnland, insgesamt				1.171.158	0,33	EUR	1.700.000	Unedic Asseo 0.00% 19/11/2030	1.365.440	0,38
FRANKREICH				FRANKREICH (Fortsetzung)						
EUR	2.500.000	Action Logement Services 3.13% 28/09/2037	2.362.471	0,67	EUR	1.200.000	Unedic Asseo 0.10% 25/11/2026	1.081.014	0,30	
USD	1.400.000	Agence Francaise de Developpement EPIC 4.00% 21/09/2027	1.288.752	0,36	EUR	600.000	Unedic Asseo 1.75% 25/11/2032	536.618	0,15	
				Frankreich, insgesamt				18.647.059	5,24	
				DEUTSCHLAND						
EUR	8.140.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2030			EUR	8.140.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2030	6.928.606	1,95	
EUR	441.000	Germany (Govt of) 1.30% 15/10/2027			EUR	441.000	Germany (Govt of) 1.30% 15/10/2027	422.394	0,12	
EUR	400.000	Hesse (Govt of) 0.01% 18/06/2031			EUR	400.000	Hesse (Govt of) 0.01% 18/06/2031	315.901	0,09	
EUR	2.000.000	Investitionsbank Berlin 2.75% 04/10/2027			EUR	2.000.000	Investitionsbank Berlin 2.75% 04/10/2027	1.986.679	0,56	
EUR	2.453.000	Land Berlin 2.75% 14/02/2033			EUR	2.453.000	Land Berlin 2.75% 14/02/2033	2.417.644	0,68	
EUR	3.500.000	Landwirtschaftliche Rentenbank 0.00% 22/09/2027			EUR	3.500.000	Landwirtschaftliche Rentenbank 0.00% 22/09/2027	3.069.142	0,86	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)						
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)						
DEUTSCHLAND (Fortsetzung)				NIEDERLANDE (Fortsetzung)						
EUR	1.475.000	State of North Rhine-Westphalia 0.60% 04/06/2041	944.427	0,27	EUR	500.000	Netherlands (Govt of) 0.50% 15/01/2040	351.200	0,10	
EUR	600.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 0.95% 13/03/2028	545.457	0,15			Niederlande, insgesamt	5.043.796	1,44	
Deutschland, insgesamt				16.630.250	4,68					
				SÜDKOREA						
				USD	571.000	Export-Import Bank of Korea 5.13% 11/01/2033	548.426	0,15		
						Südkorea, insgesamt	548.426	0,15		
UNGARN				SPANIEN						
EUR	1.777.000	Hungary (Govt of) 5.00% 22/02/2027	1.791.397	0,51	EUR	1.400.000	Autonomous Community of Andalusia 0.50% 30/04/2031	1.110.130	0,31	
EUR	250.000	MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt 1.38% 24/06/2025	230.254	0,06	EUR	1.000.000	Autonomous Community of Andalusia 2.40% 30/04/2032	913.014	0,26	
Ungarn, insgesamt				2.021.651	0,57	EUR	1.700.000	Autonomous Community of Madrid 0.42% 30/04/2030	1.393.384	0,39
IRLAND										
EUR	25.000	Ireland (Govt of) 1.35% 18/03/2031	22.672	0,01	EUR	700.000	Autonomous Community of Madrid 1.57% 30/04/2029	635.070	0,18	
Irland, insgesamt				22.672	0,01	EUR	3.200.000	Autonomous Community of Madrid 1.72% 30/04/2032	2.766.825	0,78
ITALIEN										
EUR	800.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 1.00% 11/02/2030	653.277	0,18	EUR	300.000	Basque (Govt of) 1.88% 30/07/2033	258.479	0,07	
EUR	700.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.00% 20/04/2027	654.689	0,18	EUR	1.500.000	Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2025	1.409.226	0,41	
EUR	800.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.13% 21/03/2026	765.117	0,22	EUR	200.000	Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2025	187.897	0,05	
EUR	250.000	Italy (Govt of) 1.50% 30/04/2045	151.373	0,04	EUR	700.000	Instituto de Credito Oficial 0.25% 30/04/2024	679.020	0,19	
Italien, insgesamt				2.224.456	0,62	EUR	1.810.000	Instituto de Credito Oficial 0.75% 31/10/2023	1.782.823	0,51
LUXEMBURG										
EUR	775.000	Luxembourg (Govt of) 0.00% 14/09/2032	590.271	0,17	EUR	25.000	Spain (Govt of) 1.00% 30/07/2042	15.837	0,00	
Luxemburg, insgesamt				590.271	0,17	EUR	400.000	Xunta de Galicia 0.08% 30/07/2027	351.421	0,10
				Spanien, insgesamt						
				11.503.126						
				3,25						
NIEDERLANDE				SUPRANATIONAL						
EUR	1.800.000	BNG Bank NV 3.00% 11/01/2033	1.784.622	0,50	CAD	300.000	Asian Development Bank 1.50% 04/05/2028	186.602	0,05	
EUR	600.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 0.13% 03/09/2035	413.809	0,12	CAD	800.000	Asian Development Bank 1.63% 28/01/2025	520.850	0,15	
EUR	800.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 1.50% 15/06/2039	627.208	0,18	GBP	1.500.000	Asian Development Bank FRN 23/05/2029	1.774.905	0,50	
EUR	1.900.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 2.75% 17/12/2029	1.866.957	0,54	USD	200.000	Central American Bank for Economic Integration 5.00% 09/02/2026	186.040	0,05	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					
SUPRANATIONAL (Fortsetzung)				SCHWEDEN					
EUR	1.000.000	Council of Europe Development Bank 0.00% 10/04/2026	912.814	0,26	SEK	3.000.000	Sweden (Govt of) 0.13% 09/09/2030	228.207	0,06
EUR	1.450.000	Council of Europe Development Bank 0.38% 27/03/2025	1.371.154	0,39	Schweden, insgesamt				
EUR	5.000.000	Council of Europe Development Bank 1.00% 13/04/2029	4.460.697	1,26	VEREINIGTES KÖNIGREICH				
EUR	4.000.000	Council Of Europe Development Bank 0.00% 09/04/2027	3.547.004	0,99	GBP	1.118.000	International Finance Facility for Immunisation Company 2.75% 07/06/2025	1.232.254	0,35
EUR	2.000.000	European Investment Bank 0.00% 15/05/2028	1.724.362	0,49	GBP	5.000	United Kingdom Gilt 0.88% 31/07/2033	4.387	0,00
GBP	975.000	European Investment Bank 0.88% 15/05/2026	1.006.748	0,28	Vereinigtes Königreich, insgesamt				
EUR	100.000	European Union 0.00% 04/07/2035	68.428	0,02	91.675.946 25,84				
EUR	700.000	European Union 0.00% 04/07/2035	478.995	0,14	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt				
EUR	1.700.000	European Union 0.10% 04/10/2040	988.051	0,28	348.262.497 98,18				
EUR	5.240.000	European Union 0.30% 04/11/2050	2.486.704	0,69	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren				
EUR	1.500.000	European Union 0.75% 04/01/2047	889.415	0,25	Fonds				
EUR	500.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.01% 24/04/2028	430.756	0,12	IRLAND				
EUR	399.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.20% 21/01/2061	145.182	0,04	260	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	25.702	0,01	
EUR	300.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.70% 22/10/2046	180.188	0,05	Irland, insgesamt				
EUR	100.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.70% 22/10/2046	60.063	0,02	Fonds, insgesamt				
USD	2.790.000	International Finance Facility for Immunisation Company 0.38% 06/11/2023	2.502.767	0,71	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt				
USD	1.950.000	International Finance Facility for Immunisation Company 1.00% 21/04/2026	1.632.950	0,46	25.702 0,01				
SEK	3.000.000	Nordic Investment Bank 0.10% 13/10/2025	244.988	0,07	Wert der Anlagen, insgesamt				
EUR	1.100.000	Nordic Investment Bank 2.50% 30/01/2030	1.072.306	0,30	348.288.199 98,19				
Supranational, insgesamt				26.871.969	7,57	(Gesamtkosten: EUR 397.241.488)			

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
AUSTRALIEN				DÄNEMARK					
EUR	823.000	APA Infrastructure Limited 1.25% 15/03/2033	606.813	0,45	USD	1.819.000	Danske Bank AS 1.55% 15/01/2028	1.466.217	1,07
EUR	935.000	APA Infrastructure Limited 2.00% 15/07/2030	794.491	0,58	Dänemark, insgesamt				
EUR	418.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	318.911	0,23	FRANKREICH				
EUR	250.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	190.736	0,14	EUR	152.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	119.276	0,09
EUR	600.000	Australia & New Zealand Banking Group Limited FRN 05/05/2031	522.993	0,38	EUR	363.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	273.704	0,20
EUR	1.135.000	NBN Company Limited 4.13% 15/03/2029	1.161.260	0,86	EUR	1.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 4.13% 13/03/2029	1.019.315	0,75
GBP	840.000	Pacific National Finance Pty Limited 5.00% 19/09/2023	947.711	0,70	EUR	1.000.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	720.135	0,53
EUR	1.200.000	Westpac Banking Corp. 3.80% 17/01/2030	1.192.964	0,87	USD	850.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	686.393	0,50
USD	1.270.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	1.128.593	0,83	EUR	377.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	115.833	0,09
Australien, insgesamt			6.864.472	5,04	EUR	480.000	Chrome Holdco SASU 5.00% 31/05/2029	356.926	0,26
BELGIEN				EUR	515.000	Constellium SE 3.13% 15/07/2029	419.027	0,31	
EUR	364.000	Azelis Finance NV 5.75% 15/03/2028	369.460	0,27	EUR	200.000	Electricite de France SA FRN 06/12/2171	196.158	0,14
EUR	400.000	Kbc Group NV Perp FRN	338.138	0,25	EUR	431.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	378.494	0,28
Belgien, insgesamt			707.598	0,52	EUR	357.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2027	312.313	0,23
BERMUDAS				EUR	239.000	Faurecia SE 7.25% 15/06/2026	247.016	0,18	
USD	833.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	754.369	0,56	EUR	367.000	Foncia Management SA 3.38% 31/03/2028	291.345	0,21
Bermudas, insgesamt			754.369	0,56	EUR	677.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	658.262	0,48
KANADA				EUR	554.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	534.933	0,39	
EUR	299.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	260.870	0,19	EUR	200.000	iliad SA 1.50% 14/10/2024	191.917	0,14
Kanada, insgesamt			260.870	0,19	EUR	200.000	iliad SA 1.88% 11/02/2028	168.386	0,12
KAIMANINSELN				EUR	400.000	iliad SA 5.38% 14/06/2027	397.563	0,29	
USD	889.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	697.453	0,52	EUR	270.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	267.449	0,20
GBP	2.605.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	2.567.986	1,88	Frankreich, insgesamt			7.354.445	5,39
USD	534.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050	324.641	0,24	DEUTSCHLAND				
Kaimaninseln, insgesamt			3.590.080	2,64	EUR	700.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	578.640	0,43
				EUR	1.000.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	739.132	0,54	
				EUR	600.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	611.635	0,45	
				EUR	477.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	441.460	0,33	
				EUR	131.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	122.303	0,09	
				EUR	400.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	329.461	0,24	
				EUR	200.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	188.219	0,14	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)						
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)						
DEUTSCHLAND (Fortsetzung)				GUATEMALA						
EUR	200.000	Commerzbank AG FRN 06/12/2032	198.150	0,15	USD	800.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	679.215	0,50	
EUR	500.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	394.691	0,29	Guatemala, insgesamt					
EUR	300.000	Deutsche Bank AG FRN 05/09/2030	286.882	0,21	679.215 0,50					
USD	200.000	Deutsche Bank AG FRN 10/02/2034	171.477	0,13	INDIEN					
EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	192.976	0,14	USD	1.328.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	935.154	0,68	
EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	186.795	0,14	USD	535.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	432.482	0,32	
EUR	400.000	Hannover Rueck SE FRN 26/08/2043	408.844	0,30	Indien, insgesamt					
EUR	338.960	IHO Verwaltungs GmbH 8.75% 15/05/2028	347.594	0,26	1.367.636 1,00					
EUR	7.500.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.01% 05/05/2027	6.671.201	4,90	IRLAND					
EUR	600.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	459.850	0,34	EUR	450.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	408.141	0,30	
EUR	513.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	447.773	0,32	EUR	461.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	430.490	0,32	
EUR	492.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	427.563	0,32	EUR	720.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	619.044	0,46	
EUR	705.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	574.195	0,42	EUR	969.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	920.619	0,68	
EUR	316.511	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	301.652	0,22	GBP	135.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 4.88% 15/07/2028	131.257	0,10	
EUR	200.000	Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029	158.482	0,12	Irland, insgesamt					
EUR	500.000	Vier Gas Transport GmbH 4.00% 26/09/2027	502.633	0,37	2.509.551 1,86					
EUR	1.400.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	1.446.289	1,06	ITALIEN					
EUR	1.200.000	Volkswagen Financial Services AG 0.38% 12/02/2030	929.637	0,68	EUR	880.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	741.587	0,55	
EUR	300.000	Vonovia SE 5.00% 23/11/2030	281.364	0,21	EUR	565.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	458.197	0,34	
Deutschland, insgesamt				17.398.898	12,80	EUR	216.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.75% 24/01/2031	213.502	0,16
GIBRALTAR				EUR 371.000				ENI SpA - Perp FRN	309.979	0,23
EUR	160.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	136.213	0,10	EUR	387.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	345.688	0,25	
Gibraltar, insgesamt				136.213	0,10	EUR	586.000	IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3.75% 15/01/2028	516.657	0,38
GRIECHENLAND				EUR 287.000				International Design Group SpA 6.50% 15/11/2025	277.113	0,20
EUR	774.000	Eurobank SA FRN 26/01/2029	754.537	0,55	USD	400.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	321.858	0,24	
Griechenland, insgesamt				754.537	0,55	EUR	150.000	Lottomatica SpA 6.25% 15/07/2025	149.908	0,11
				EUR 178.000				Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	189.187	0,14

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
ITALIEN (Fortsetzung)				LUXEMBURG (Fortsetzung)					
EUR	241.000	Telecom Italia SpA 6.88% 15/02/2028	246.594	0,18	EUR	1.542.000	SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	1.417.292	1,04
Italien, insgesamt			3.770.270	2,78	Luxemburg, insgesamt			10.627.287	7,81
JERSEY - KANALINSELN				MEXIKO					
GBP	196.000	Heathrow Funding Limited 6.45% 10/12/2031	237.712	0,17	EUR	486.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 16/04/2026	435.236	0,32
EUR	245.000	Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	227.033	0,17	EUR	214.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	169.584	0,12
Jersey - Kanalinseln, insgesamt			464.745	0,34	Mexiko, insgesamt			604.820	0,44
LUXEMBURG				NIEDERLANDE					
EUR	428.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	342.267	0,25	EUR	362.000	ASR Nederland NV FRN 07/12/2043	375.845	0,28
EUR	843.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	632.878	0,46	USD	505.000	Braskem Netherlands Finance BV 7.25% 13/02/2033	449.108	0,33
EUR	2.200.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	1.476.812	1,09	EUR	160.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	156.272	0,11
GBP	300.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	215.830	0,16	EUR	525.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	510.907	0,38
GBP	383.000	B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	410.464	0,30	EUR	350.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	246.706	0,18
EUR	662.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	541.270	0,40	EUR	545.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	384.157	0,28
EUR	128.869	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	128.856	0,09	GBP	1.508.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	1.809.972	1,34
EUR	311.000	Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	302.213	0,22	EUR	700.000	ING Groep NV FRN 29/09/2028	585.947	0,43
GBP	266.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.75% 01/11/2025	230.595	0,17	EUR	800.000	ING Groep NV FRN 16/02/2031	673.362	0,50
EUR	1.200.000	Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	848.448	0,62	EUR	450.000	LKQ European Holdings BV 4.13% 01/04/2028	436.307	0,32
USD	200.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl 6.13% 23/02/2038	189.732	0,14	USD	667.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	526.134	0,39
EUR	1.430.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	1.219.963	0,90	EUR	416.000	Nobel Bidco BV 3.13% 15/06/2028	294.912	0,22
EUR	301.169	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	299.744	0,22	EUR	519.000	Sagax Euro Mtn NL BV 0.75% 26/01/2028	380.696	0,28
EUR	280.000	Loarre Investments Sarl 6.50% 15/05/2029	261.350	0,20	EUR	1.258.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	1.059.182	0,78
EUR	160.000	Loarre Investments Sarl FRN 15/05/2029	154.397	0,11	EUR	610.000	Stichting AK Rabobank Certificaten 6.50% 29/03/2070	590.608	0,43
USD	812.700	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	691.238	0,51	EUR	496.921	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	389.901	0,29
EUR	1.406.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	1.057.430	0,78	EUR	100.000	Telefonica Europe BV FRN 23/11/2171	102.023	0,07
EUR	222.000	Sani/lkos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	206.508	0,15	EUR	100.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	83.333	0,06
					EUR	600.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	587.009	0,43
					EUR	1.147.000	Tennet Holding BV FRN 22/10/2168	1.071.534	0,79

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
NIEDERLANDE (Fortsetzung)				SCHWEIZ (Fortsetzung)					
EUR	1.000.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	751.074	0,55	EUR	1.255.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	824.054	0,61
EUR	280.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	259.187	0,19	EUR	300.000	Credit Suisse Group AG FRN 02/04/2032	251.399	0,18
EUR	261.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	215.893	0,16	Schweiz, insgesamt				
EUR	109.000	United Group BV 4.63% 15/08/2028	80.849	0,06	1.751.714				
EUR	284.000	Villa Dutch Bidco BV 9.00% 03/11/2029	269.254	0,20	1,29				
Niederlande, insgesamt				12.290.172					
9,05				VEREINIGTES KÖNIGREICH					
SPANIEN				GBP					
GBP	700.000	Banco Santander SA 5.13% 25/01/2030	782.950	0,58	GBP	500.000	Anglian Water Osprey Financing plc 2.00% 31/07/2028	459.493	0,34
EUR	300.000	Cellnex Finance Company SA 0.75% 15/11/2026	265.046	0,20	EUR	318.000	Anglo American Capital plc 4.75% 21/09/2032	320.649	0,24
EUR	200.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	166.719	0,12	EUR	220.000	Anglo American Capital plc 5.00% 15/03/2031	225.995	0,17
EUR	823.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	750.932	0,55	EUR	300.000	BCP V Modular Services Finance II plc 4.75% 30/11/2028	255.642	0,19
EUR	155.000	Kaixo Bondco Telecom SA 5.13% 30/09/2029	136.463	0,10	GBP	710.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	528.004	0,38
EUR	553.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	509.161	0,37	EUR	1.113.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	1.031.931	0,76
EUR	298.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	278.398	0,20	EUR	936.000	British American Tobacco plc FRN 27/12/2169	764.040	0,56
Spanien, insgesamt				2.889.669					
2,12				GBP					
SCHWEDEN				EUR					
EUR	345.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2170	177.524	0,13	EUR	632.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	584.157	0,42
EUR	660.000	Heimstaden Bostad AB FRN 15/04/2169	351.392	0,26	EUR	1.074.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	1.046.949	0,77
EUR	91.194	Intrum AB 3.13% 15/07/2024	87.781	0,06	USD	728.000	HSBC Holdings plc FRN 11/08/2033	664.125	0,49
EUR	164.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	151.976	0,11	USD	304.000	HSBC Holdings plc FRN 09/03/2044	296.718	0,22
EUR	1.371.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	1.114.444	0,82	GBP	576.000	HSBC Holdings plc FRN 16/11/2034	689.430	0,51
EUR	194.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	172.533	0,13	EUR	158.000	INEOS Finance plc 2.13% 15/11/2025	148.555	0,11
EUR	115.000	Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	115.354	0,08	EUR	331.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	310.556	0,23
EUR	555.000	Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	462.442	0,34	EUR	61.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	57.232	0,04
Schweden, insgesamt				2.633.446					
1,93				EUR					
SCHWEIZ				EUR					
EUR	857.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	676.261	0,50	EUR	192.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	172.814	0,13

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN					
EUR	130.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	117.009	0,09	EUR	1.034.000	Air Products and Chemicals Inc. 4.00% 03/03/2035	1.041.245	0,77
GBP	304.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	329.308	0,24	USD	209.000	Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	163.436	0,12
GBP	315.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	340.566	0,25	USD	560.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	527.290	0,39
GBP	175.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	180.402	0,13	USD	901.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	852.482	0,62
GBP	380.733	Mitchells & Butlers Finance plc 6.01% 15/12/2028	404.394	0,30	USD	295.000	Amgen Inc. 5.75% 02/03/2063	282.706	0,21
EUR	483.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	473.727	0,35	EUR	660.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	546.561	0,40
EUR	600.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	485.713	0,36	EUR	190.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 3.00% 01/09/2029	141.841	0,10
EUR	602.000	NatWest Group plc FRN 14/09/2032	493.418	0,36	EUR	540.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	428.629	0,32
EUR	1.587.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	1.336.719	0,98	EUR	713.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	565.949	0,42
EUR	244.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	226.300	0,17	EUR	521.000	Bank of America Corp. FRN 24/05/2032	409.990	0,30
GBP	297.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	313.001	0,23	EUR	889.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 1.50% 18/03/2030	782.533	0,58
GBP	165.000	Santander UK plc Perp 10.06% 15/11/2026	272.361	0,20	USD	243.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	223.689	0,16
EUR	481.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	414.876	0,31	EUR	485.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	437.514	0,32
EUR	340.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	312.915	0,23	GBP	319.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	346.074	0,25
GBP	620.000	Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	624.817	0,46	EUR	113.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	108.554	0,08
EUR	800.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	691.708	0,51	GBP	145.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	158.652	0,12
EUR	489.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	396.589	0,29	EUR	938.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.87% 03/08/2027	910.470	0,67
GBP	221.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.25% 15/01/2030	205.204	0,15	GBP	491.000	Ford Motor Credit Company LLC 6.86% 05/06/2026	558.241	0,41
GBP	400.000	Virgin Money UK plc FRN 24/04/2026	422.245	0,31	USD	118.000	Goodman USA Finance Three LLC 3.70% 15/03/2028	100.373	0,07
EUR	317.000	Virgin Money UK plc FRN 29/10/2028	302.403	0,22	EUR	428.000	Honeywell International Inc. 4.13% 02/11/2034	434.466	0,32
GBP	429.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.00% 31/01/2029	404.884	0,30	GBP	342.000	International Business Machines Corp. 4.88% 06/02/2038	376.130	0,28
EUR	432.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	395.327	0,29	USD	560.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	428.343	0,31
USD	650.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	585.703	0,43	USD	1.627.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	1.259.305	0,92
GBP	227.000	Wessex Water Services Finance plc 5.13% 31/10/2032	255.144	0,19	EUR	576.000	Metropolitan Life Global Funding I 3.75% 05/12/2030	568.947	0,42
GBP	752.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	647.485	0,48	GBP	492.000	Morgan Stanley FRN 18/11/2033	571.148	0,42
		Vereinigtes Königreich, insgesamt	20.509.948	15,09	GBP	200.000	MPT Operating Partnership LP 2.55% 05/12/2023	216.631	0,16

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				ELFENBEINKÜSTE					
EUR	1.728.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	1.668.125	1,23	EUR	250.000	Ivory Coast (Govt of) 5.25% 22/03/2030	206.080	0,15
EUR	2.160.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	2.125.447	1,56	EUR	290.000	Ivory Coast (Govt of) 5.88% 17/10/2031	238.859	0,18
EUR	1.212.000	New York Life Global Funding 3.63% 09/01/2030	1.185.038	0,86	Elfenbeinküste, insgesamt				
EUR	638.000	Northwestern Mutual Global Funding 4.11% 15/03/2030	646.514	0,48	444.939 0,33				
USD	220.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	214.005	0,16	SENEGAL				
USD	265.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	284.007	0,21	EUR	390.000	Senegal (Govt of) 4.75% 13/03/2028	328.643	0,24
EUR	513.000	Olympus Water USA Holding Corp. 3.88% 01/10/2028	418.976	0,31	Senegal, insgesamt				
EUR	280.000	Southern Company FRN 15/09/2081	221.999	0,16	328.643 0,24				
USD	1.070.000	Stellantis Finance USA Inc. 6.38% 12/09/2032	1.033.720	0,76	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt				
GBP	350.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	384.569	0,28	4.298.403 3,16				
USD	1.738.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	1.298.889	0,95	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt				
Vereinigte Staaten, insgesamt			21.922.488	16,10	125.607.063 92,33				
Anleihen, insgesamt				121.308.660	89,17	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere			
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				Anleihen					
ÄGYPTEN				NIEDERLANDE					
EUR	450.000	Egypt (Govt of) 5.63% 16/04/2030	270.450	0,20	USD	467.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	426.889	0,31
Ägypten, insgesamt			270.450	0,20	Niederlande, insgesamt				
DEUTSCHLAND				VEREINIGTE STAATEN					
EUR	2.300.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.01% 31/03/2025	2.168.516	1,59	USD	52.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	53.735	0,04
GBP	800.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.13% 04/07/2025	852.983	0,63	Vereinigte Staaten, insgesamt				
Deutschland, insgesamt			3.021.499	2,22	Anleihen, insgesamt				
UNGARN				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt					
EUR	231.000	Hungary (Govt of) 5.00% 22/02/2027	232.872	0,17	480.624 0,35				
Ungarn, insgesamt			232.872	0,17					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				
Anleihen				
PORTUGAL				
EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	11.000	0,01
		Portugal, insgesamt	11.000	0,01
VEREINIGTES KÖNIGREICH				
EUR	451.000	BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30/11/2029	361.422	0,27
GBP	812.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	867.134	0,64
GBP	375.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	357.457	0,26
		Vereinigtes Königreich, insgesamt	1.586.013	1,17
		Anleihen, insgesamt	1.597.013	1,18
		Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt	1.597.013	1,18
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren				
Fonds				
IRLAND				
	10.150	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	1.003.346	0,74
		Irland, insgesamt	1.003.346	0,74
		Fonds, insgesamt	1.003.346	0,74
		Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt	1.003.346	0,74
		Wert der Anlagen, insgesamt	128.688.046	94,60
		(Gesamtkosten: EUR 144.483.819)		

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

**Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
BERMUDAS				KOLUMBIEN					
USD	200.000	Ooredoo International Finance Limited 2.63% 08/04/2031	173.952	0,45	USD	500.000	Ecopetrol SA 4.63% 02/11/2031	389.133	1,01
					USD	500.000	Ecopetrol SA 6.88% 29/04/2030	460.957	1,20
		Bermudas, insgesamt	173.952	0,45			Kolumbien, insgesamt	850.090	2,21
BRASILIEN				GHANA					
USD	500.000	Light Servicos de Eletricidade SA 4.38% 18/06/2026	147.813	0,38	USD	200.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	119.750	0,31
		Brasilien, insgesamt	147.813	0,38			Ghana, insgesamt	119.750	0,31
KANADA				GUATEMALA					
USD	300.000	MEGlobal Canada ULC 5.00% 18/05/2025	298.266	0,77	USD	460.000	CT Trust 5.13% 03/02/2032	384.813	1,00
		Kanada, insgesamt	298.266	0,77	USD	600.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	553.450	1,43
							Guatemala, insgesamt	938.263	2,43
KAIMANINSELN				HONGKONG					
USD	200.000	AAC Technologies Holdings Inc. 3.00% 27/11/2024	186.380	0,48	USD	800.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	807.390	2,09
USD	200.000	CIFI Holdings Group Company Limited 0.00% 16/07/2025	42.769	0,11	USD	214.000	Lenovo Group Limited 6.54% 27/07/2032	216.863	0,56
USD	200.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	189.145	0,49	USD	330.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	250.763	0,65
USD	440.000	Country Garden Holdings Company Limited 3.13% 22/10/2025	258.299	0,67			Hongkong, insgesamt	1.275.016	3,30
USD	212.000	ENN Energy Holdings Limited 2.63% 17/09/2030	177.723	0,46	INDIEN				
USD	400.000	Goodman HK Finance 3.00% 22/07/2030	342.638	0,89	USD	250.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	179.688	0,47
USD	400.000	Meituan 3.05% 28/10/2030	320.404	0,83	USD	220.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	190.575	0,49
USD	400.000	Melco Resorts Finance Limited 5.75% 21/07/2028	342.500	0,89	USD	400.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	317.351	0,82
USD	200.000	MGM China Holdings Limited 4.75% 01/02/2027	178.187	0,46	USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.20% 04/08/2027	159.023	0,41
USD	200.000	QNB Finance Limited 2.75% 12/02/2027	186.108	0,48	USD	200.000	Bharti Airtel Limited 4.38% 10/06/2025	196.977	0,51
USD	200.000	QNB Finance Limited 2.75% 12/02/2027	186.108	0,48	USD	400.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	351.304	0,91
USD	400.000	Saudi Electricity Global Sukuk Company 5 2.41% 17/09/2030	346.568	0,90	USD	200.000	Indian Railway Finance Corp. Limited 3.57% 21/01/2032	174.447	0,45
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 2.88% 22/04/2031	172.474	0,45	USD	200.000	JSW Steel Limited 5.95% 18/04/2024	197.944	0,52
USD	367.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1.63% 24/09/2025	336.791	0,87	USD	250.000	Reliance Industries Limited 3.67% 30/11/2027	235.268	0,61
USD	200.000	Vale Overseas Limited 3.75% 08/07/2030	178.840	0,46					
		Kaimaninseln, insgesamt	3.444.934	8,92					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
INDIEN (Fortsetzung)				LUXEMBURG					
USD	475.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	397.577	1,03	USD	500.000	Altice Financing SA 5.00% 15/01/2028	406.875	1,05
		Indien, insgesamt	2.400.154	6,22	USD	400.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl 6.13% 23/02/2038	412.269	1,07
INDONESIEN				USD 550.000 Hidrovias International Finance SARL 4.95% 08/02/2031				392.831	1,02
USD	295.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT 4.75% 13/05/2025	291.739	0,76	USD	250.000	MHP Lux SA 6.95% 03/04/2026	127.883	0,33
USD	250.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.45% 15/05/2030	246.997	0,64	USD	500.000	MHP SE 7.75% 10/05/2024	277.489	0,72
USD	600.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	22.500	0,06	USD	544.500	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	503.159	1,30
		Indonesien, insgesamt	561.236	1,46			Luxemburg, insgesamt	2.120.506	5,49
IRLAND				MAURITIUS					
USD	400.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	253.020	0,66	USD	200.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	192.794	0,50
USD	200.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 3.05% 23/01/2025	150.284	0,39	USD	400.000	HTA Group Limited 7.00% 18/12/2025	380.750	0,99
		Irland, insgesamt	403.304	1,05	USD	300.000	Network I2i Limited Perp FRN	283.986	0,74
INSEL MAN				MEXIKO					
USD	200.000	AngloGold Ashanti Holdings plc 3.75% 01/10/2030	175.051	0,45	USD	500.000	BBVA Bancomer SA FRN 13/09/2034	436.875	1,13
USD	400.000	Gohl Capital Limited 4.25% 24/01/2027	368.502	0,95	USD	400.000	Braskem Idesa SAPI 6.99% 20/02/2032	302.750	0,78
		Insel Man, insgesamt	543.553	1,40	USD	400.000	Cemex SAB de CV 7.38% 05/06/2027	413.220	1,07
JERSEY - KANALINSELN				USD 200.000 Cemex SAB de CV FRN 14/06/2171				201.443	0,52
USD	200.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	164.822	0,43	USD	237.000	Gruma SAB de CV 4.88% 01/12/2024	235.815	0,61
USD	440.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 3.25% 30/09/2040	348.725	0,90	USD	400.000	Petroleos Mexicanos 6.70% 16/02/2032	319.347	0,83
		Jersey - Kanalinseln, insgesamt	513.547	1,33	USD	118.000	Petroleos Mexicanos 10.00% 07/02/2033	112.690	0,29
KASACHSTAN				USD 400.000 Sitios Latinoamerica SAB de CV 5.38% 04/04/2032				360.467	0,93
USD	400.000	KazMunayGas National Company JSC 4.75% 24/04/2025	389.906	1,01			Mexiko, insgesamt	2.382.607	6,16
USD	400.000	KazMunayGas National Company JSC 6.38% 24/10/2048	333.750	0,86	MAROKKO				
		Kasachstan, insgesamt	723.656	1,87	USD	240.000	OCP SA 3.75% 23/06/2031	198.382	0,51
					USD	557.000	OCP SA 6.88% 25/04/2044	507.572	1,32
							Marokko, insgesamt	705.954	1,83

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
NIEDERLANDE				SAUDI-ARABIEN					
USD	330.000	Braskem Netherlands Finance BV 4.50% 31/01/2030	281.418	0,73	USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	338.454	0,88
USD	357.200	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	321.480	0,83	USD	500.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	423.068	1,10
USD	230.000	Metinvest BV 8.50% 23/04/2026	142.600	0,37	USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 3.50% 16/04/2029	375.204	0,97
USD	500.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	428.499	1,11	USD	200.000	Saudi Arabian Oil Company 3.50% 16/04/2029	187.602	0,49
USD	392.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 3.15% 01/10/2026	355.005	0,92	Saudi-Arabien, insgesamt			1.324.328	3,44
USD	250.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 4.75% 09/05/2027	234.780	0,61	SINGAPUR				
USD	200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 7.88% 15/09/2029	209.625	0,54	USD	200.000	BOC Aviation Limited 2.63% 17/09/2030	171.157	0,44
Niederlande, insgesamt			1.973.407	5,11	USD	600.000	DBS Group Holdings Limited FRN 11/12/2028	596.860	1,55
PERU				Singapur, insgesamt				1.346.683	3,48
USD	500.000	Auna SAA 6.50% 20/11/2025	378.125	0,98	USD	200.000	SingTel Group Treasury Pte Limited 2.38% 28/08/2029	175.482	0,45
USD	95.000	Volcan Compania Minera SAA 4.38% 11/02/2026	79.167	0,21	USD	450.000	United Overseas Bank Limited FRN 16/03/2031	403.184	1,04
Peru, insgesamt			457.292	1,19	Singapur, insgesamt			1.346.683	3,48
PHILIPPINEN				SÜDAFRIKA					
USD	250.000	Globe Telecom Inc. 2.50% 23/07/2030	200.720	0,52	USD	200.000	Eskom Holdings 6.75% 06/08/2023	198.737	0,51
USD	200.000	International Container Terminal Services Inc. 4.75% 17/06/2030	188.513	0,49	USD	250.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	246.384	0,64
USD	357.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	325.537	0,84	Südafrika, insgesamt			445.121	1,15
USD	200.000	PLDT Inc. 2.50% 23/01/2031	162.060	0,42	THAILAND				
USD	230.000	SMC Global Power Holdings Corp. Perp FRN	188.781	0,49	USD	700.000	Bangkok Bank pcl FRN 25/09/2034	596.625	1,55
Philippinen, insgesamt			1.065.611	2,76	USD	235.000	GC Treasury Center Company Limited 4.30% 18/03/2051	170.595	0,44
KATAR				Thailand, insgesamt				1.108.166	2,88
USD	410.000	QatarEnergy 2.25% 12/07/2031	348.836	0,90	USD	200.000	GCTreasury Centre Company 2.98% 18/03/2031	164.568	0,43
Katar, insgesamt			348.836	0,90	USD	200.000	Kasikornbank pcl FRN 02/10/2031	176.378	0,46
SÜDKOREA				TÜRKEI					
USD	200.000	Kookmin Bank 4.50% 01/02/2029	190.018	0,49	USD	380.000	KOC Holding AS 6.50% 11/03/2025	379.109	0,99
Südkorea, insgesamt			190.018	0,49	USD	450.000	Türk Telekomunikasyon AS 6.88% 28/02/2025	433.683	1,13
				Türkei, insgesamt			812.792	2,12	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente					
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				TÜRKEI					
USD	700.000	DP World Limited 6.85% 02/07/2037	782.431	2,03	USD	200.000	Turkey (Govt of) 4.88% 09/10/2026	181.232	0,47
		Vereinigte Arabische Emirate, insgesamt	782.431	2,03	USD	310.000	Turkey (Govt of) 9.38% 19/01/2033	317.108	0,82
VEREINIGTES KÖNIGREICH				Türkei, insgesamt					
USD	300.000	Gazprom PJSC Via Gaz Finance plc 3.25% 25/02/2030	189.375	0,49	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt				
USD	450.000	Nak Naftogaz Ukraine Via Kondor Finance plc 7.63% 08/11/2026	89.250	0,23	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt				
		Vereinigtes Königreich, insgesamt	278.625	0,72	32.885.899 85,21				
BRITISCHE JUNGFERNINSELN				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren					
USD	460.000	Central American Bottling Corp. 5.25% 27/04/2029	427.789	1,11	Fonds				
USD	400.000	Contemporary Ruiding Development Limited 2.63% 17/09/2030	339.978	0,88	IRLAND				
USD	400.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	359.519	0,93	2.549.478	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund		2.549.478	6,61
USD	450.000	FPC Resources Limited 4.38% 11/09/2027	419.605	1,09	Irland, insgesamt				
USD	400.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	403.613	1,04	2.549.478 6,61				
USD	511.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	456.896	1,19	Fonds, insgesamt				
USD	728.000	JGSH Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	655.548	1,70	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt				
USD	400.000	Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	308.000	0,80	2.549.478 6,61				
USD	467.000	Tsmc Global Limited 0.75% 28/09/2025	423.170	1,10	Wert der Anlagen, insgesamt				
		Britische Jungferninseln, insgesamt	3.794.118	9,84	35.435.377 91,82				
Anleihen, insgesamt				32.387.559 83,92					

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
ASERBAIDSCHAN				INDIEN (Fortsetzung)					
USD	200.000	Azerbaijan (Govt of) 3.50% 01/09/2032	170.901	0,56	USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	158.675	0,52
Aserbaidtschan, insgesamt			170.901	0,56	Indien, insgesamt			302.425	0,99
BERMUDAS				INDONESIEN					
USD	200.000	Ooredoo International Finance Limited 2.63% 08/04/2031	173.952	0,57	USD	450.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.45% 15/05/2030	444.594	1,46
Bermudas, insgesamt			173.952	0,57	Indonesien, insgesamt			444.594	1,46
KAIMANINSELN				IRLAND					
USD	319.000	Gaci First Investment Company 4.88% 14/02/2035	313.786	1,03	USD	200.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	126.510	0,42
USD	343.000	Gaci First Investment Company 5.25% 13/10/2032	356.801	1,18	Irland, insgesamt			126.510	0,42
Kaimaninseln, insgesamt			670.587	2,21	INSEL MAN				
USD	345.000	Ecopetrol SA 6.88% 29/04/2030	318.061	1,05	USD	200.000	AngloGold Ashanti Holdings plc 3.75% 01/10/2030	175.051	0,58
Kolumbien, insgesamt			318.061	1,05	Insel Man, insgesamt			175.051	0,58
GHANA				JERSEY - KANALINSELN					
USD	230.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	137.713	0,45	USD	253.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	208.500	0,69
Ghana, insgesamt			137.713	0,45	USD	263.108	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.94% 30/09/2040	214.167	0,70
GUATEMALA				Jersey - Kanalinseln, insgesamt				422.667	1,39
USD	200.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	184.483	0,61	KASACHSTAN				
Guatemala, insgesamt			184.483	0,61	USD	200.000	KazMunayGas National Company JSC 4.75% 19/04/2027	184.624	0,61
HONGKONG				Kasachstan, insgesamt				541.664	1,77
USD	200.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	201.848	0,66	USD	400.000	KazMunayGas National Company JSC 5.38% 24/04/2030	357.040	1,16
USD	274.000	Lenovo Group Limited 6.54% 27/07/2032	277.665	0,92	LUXEMBURG				
USD	210.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	159.577	0,52	USD	200.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl 6.13% 23/02/2038	206.135	0,68
Hongkong, insgesamt			639.090	2,10	USD	180.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	166.334	0,55
INDIEN				Luxemburg, insgesamt				372.469	1,23
USD	200.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	143.750	0,47					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
MALAYSIA				VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE					
USD	200.000	Petronas Capital Limited 3.50% 21/04/2030	187.133	0,62	USD	200.000	Abu Dhabi Ports Company PJSC 2.50% 06/05/2031	169.500	0,56
		Malaysia, insgesamt	187.133	0,62	USD	500.000	DP World Limited 6.85% 02/07/2037	558.879	1,84
MEXIKO				VEREINIGTES KÖNIGREICH					
USD	450.000	Comision Federal de Electricidad 3.88% 26/07/2033	344.796	1,14	USD	200.000	MDGH GMTN RSC Limited 5.50% 28/04/2033	213.127	0,70
USD	300.000	Petroleos Mexicanos 5.95% 28/01/2031	229.896	0,76			Vereinigte Arabische Emirate, insgesamt	941.506	3,10
USD	430.000	Petroleos Mexicanos 6.38% 23/01/2045	272.794	0,90	USD	204.000	Gazprom PJSC Via Gaz Finance plc 3.25% 25/02/2030	128.775	0,42
USD	900.000	Petroleos Mexicanos 6.70% 16/02/2032	718.531	2,35			Vereinigtes Königreich, insgesamt	128.775	0,42
USD	200.000	Petroleos Mexicanos 7.69% 23/01/2050	141.370	0,47	VEREINIGTE STAATEN				
USD	96.000	Petroleos Mexicanos 10.00% 07/02/2033	91.680	0,30	USD	378.000	Petroleos Mexicanos 6.63% 15/06/2035	276.316	0,91
		Mexiko, insgesamt	1.799.067	5,92			Vereinigte Staaten, insgesamt	276.316	0,91
NIEDERLANDE				BRITISCHE JUNGFERNINSELN					
USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	214.250	0,70	USD	220.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	221.988	0,73
		Niederlande, insgesamt	214.250	0,70	USD	489.000	JGSH Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	440.333	1,45
KATAR				ANLEIHEN, INSGESAMT					
USD	356.000	QatarEnergy 2.25% 12/07/2031	302.892	1,00	USD	200.000	State Grid Overseas Investment BVI Limited 1.63% 05/08/2030	165.157	0,54
		Katar, insgesamt	302.892	1,00	USD	265.000	Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	204.050	0,67
SAUDI-ARABIEN				BRITISCHE JUNGFERNINSELN, insgesamt					
USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	338.454	1,11			1.031.528	3,39	
		Saudi-Arabien, insgesamt	338.454	1,11	Anleihen, insgesamt				
							10.289.942	33,85	
SÜDAFRIKA				HYPOTHEKENBESICHERTE ANLEIHEN UND ABS-ANLEIHEN					
USD	200.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	197.107	0,65	LUXEMBURG				
		Südafrika, insgesamt	197.107	0,65	USD	180.000	Millicom International Cellular SA 5.13% 15/01/2028	160.763	0,53
TÜRKEI				Luxemburg, insgesamt					
USD	200.000	Turk Telekomunikasyon AS 6.88% 28/02/2025	192.747	0,64			160.763	0,53	
		Türkei, insgesamt	192.747	0,64	Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS- Anleihen, insgesamt				
							160.763	0,53	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)						
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)						
ANGOLA				KOLUMBIEN (Fortsetzung)						
USD	200.000	Angola (Govt of) 8.00% 26/11/2029	171.697	0,56	USD	223.000	Colombia (Govt of) 3.25% 22/04/2032	167.005	0,55	
USD	200.000	Angola (Govt of) 9.38% 08/05/2048	157.896	0,52	Kolumbien, insgesamt					
Angola, insgesamt				329.593	1,08	1.065.066				
ARGENTINIEN				KROATIEN						
USD	1.850.000	Argentina (Govt of) FRN 09/07/2035	485.311	1,60	USD	200.000	Croatia (Govt of) 6.00% 26/01/2024	201.577	0,66	
USD	90.000	Argentina (Govt of) 1.50% 09/07/2046	24.297	0,08	Kroatien, insgesamt					
Argentinien, insgesamt				509.608	1,68	201.577				
BAHRAIN				DOMINIKANISCHE REPUBLIK						
USD	300.000	Bahrain (Govt of) 5.63% 18/05/2034	263.661	0,87	USD	200.000	Dominican Republic (Govt of) 4.88% 23/09/2032	170.820	0,56	
USD	333.000	CBB International Sukuk Programme Company WLL 3.88% 18/05/2029	301.968	0,99	USD	222.000	Dominican Republic (Govt of) 5.88% 30/01/2060	170.558	0,56	
Bahrain, insgesamt				565.629	1,86	USD	151.000	Dominican Republic (Govt of) 6.40% 05/06/2049	126.878	0,42
BRASILIEN				DOMINIKANISCHE REPUBLIK, insgesamt						
USD	433.000	Brazil (Govt of) 3.88% 12/06/2030	388.621	1,28	570.708					
USD	200.000	Brazil (Govt of) 5.00% 27/01/2045	158.261	0,52	ECUADOR					
Brasilien, insgesamt				546.882	1,80	USD	192.950	Ecuador (Govt of) 1.50% 31/07/2040	58.781	0,19
CHILE				ECUADOR, insgesamt						
USD	200.000	Chile (Govt of) 3.50% 25/01/2050	150.766	0,50	173.649					
Chile, insgesamt				150.766	0,50	ÄGYPTEN				
CHINA				GHANA						
USD	200.000	China (Govt of) 1.95% 03/12/2024	192.568	0,63	EUR	200.000	Egypt (Govt of) 6.38% 11/04/2031	130.317	0,43	
China, insgesamt				192.568	0,63	USD	250.000	Egypt (Govt of) 7.30% 30/09/2033	154.412	0,51
KOLUMBIEN				GHANA, insgesamt						
USD	800.000	Colombia (Govt of) 3.00% 30/01/2030	629.543	2,06	USD	250.000	Egypt (Govt of) 7.63% 29/05/2032	159.666	0,53	
USD	350.000	Colombia (Govt of) 3.13% 15/04/2031	268.518	0,88	USD	300.000	Egypt (Govt of) 7.90% 21/02/2048	167.563	0,55	
Kolumbien, insgesamt				898.061	2,94	Ägypten, insgesamt				
GUATEMALA				611.958						
USD	250.000	Guatemala (Govt of) 6.13% 01/06/2050	238.571	0,78	GHANA, insgesamt					
Guatemala, insgesamt				238.571	0,78	124.215				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)			
UNGARN				MONGOLEI			
USD	200.000 Hungary (Govt of) 2.13% 22/09/2031	154.624	0,51	USD	200.000 Mongolia (Govt of) 8.65% 19/01/2028	197.219	0,65
USD	200.000 Hungary (Govt of) 3.13% 21/09/2051	123.910	0,41	MONGOLEI, insgesamt			
EUR	58.000 Hungary (Govt of) 5.00% 22/02/2027	63.525	0,21	197.219 0,65			
USD	200.000 Hungary (Govt of) 6.75% 25/09/2052	208.090	0,68	NIGERIA			
Ungarn, insgesamt				USD	250.000 Nigeria (Govt of) 7.38% 28/09/2033	178.123	0,59
550.149 1,81				USD	200.000 Nigeria (Govt of) 7.63% 28/11/2047	128.542	0,42
				Nigeria, insgesamt			
				306.665 1,01			
INDIEN				OMAN			
USD	400.000 Export-Import Bank of India 3.25% 15/01/2030	353.054	1,16	USD	200.000 Oman (Govt of) 6.25% 25/01/2031	204.420	0,67
Indien, insgesamt				USD	220.000 Oman (Govt of) 6.75% 17/01/2048	209.178	0,69
353.054 1,16				Oman, insgesamt			
				413.598 1,36			
INDONESIEN				PAKISTAN			
USD	200.000 Indonesia (Govt of) 3.70% 30/10/2049	159.593	0,53	USD	200.000 Pakistan (Govt of) 6.88% 05/12/2027	72.970	0,24
USD	200.000 Indonesia (Govt of) 4.30% 31/03/2052	174.410	0,57	Pakistan, insgesamt			
USD	350.000 Indonesia (Govt of) 4.75% 18/07/2047	329.285	1,08	72.970 0,24			
IDR	5.360.000.000 Indonesia (Govt of) 6.38% 15/04/2032	349.885	1,15	PANAMA			
USD	200.000 Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.30% 23/06/2025	190.963	0,63	USD	200.000 Panama (Govt of) 2.25% 29/09/2032	153.842	0,51
Indonesien, insgesamt				USD	302.000 Panama (Govt of) 3.30% 19/01/2033	253.438	0,83
1.204.136 3,96				USD	200.000 Panama (Govt of) 4.50% 19/01/2063	144.971	0,48
				USD	200.000 Panama (Govt of) 6.40% 14/02/2035	209.273	0,69
				Panama, insgesamt			
				761.524 2,51			
ELFENBEINKÜSTE				PARAGUAY			
EUR	477.000 Ivory Coast (Govt of) 5.88% 17/10/2031	426.846	1,40	USD	340.000 Paraguay (Govt of) 5.60% 13/03/2048	303.297	1,00
Elfenbeinküste, insgesamt				USD	200.000 Paraguay (Govt of) 6.10% 11/08/2044	194.031	0,64
426.846 1,40				Paraguay, insgesamt			
				497.328 1,64			
MEXIKO							
USD	650.000 Mexico (Govt of) 3.25% 16/04/2030	584.361	1,92				
USD	300.000 Mexico (Govt of) 4.60% 10/02/2048	245.944	0,81				
MXN	85.000 Mexico (Govt of) 8.50% 31/05/2029	463.752	1,53				
Mexiko, insgesamt							
1.294.057 4,26							

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*				
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)							
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)							
PERU				TÜRKEI (Fortsetzung)							
USD	132.000	Peru (Govt of) 3.00% 15/01/2034	108.211	0,36	USD	425.000	Turkey (Govt of) 6.00% 25/03/2027	394.366	1,30		
		Peru, insgesamt	108.211	0,36	USD	250.000	Turkey (Govt of) 6.88% 17/03/2036	215.401	0,71		
PHILIPPINEN				USD				315.000	Turkey (Govt of) 9.38% 14/03/2029	321.885	1,06
USD	539.000	Philippine (Govt of) 3.20% 06/07/2046	402.120	1,32	USD	375.000	Turkey (Govt of) 9.38% 19/01/2033	383.599	1,26		
		Philippinen, insgesamt	402.120	1,32			Türkei, insgesamt	1.693.541	5,57		
KATAR				UKRAINE							
USD	450.000	Qatar (Govt of) 3.75% 16/04/2030	441.067	1,45	USD	518.000	Ukraine (Govt of) 0.00% 21/05/2031	92.123	0,30		
USD	200.000	Qatar (Govt of) 4.82% 14/03/2049	197.907	0,65	USD	560.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2026	107.100	0,35		
USD	200.000	Qatar (Govt of) 5.10% 23/04/2048	204.318	0,67			Ukraine, insgesamt	199.223	0,65		
		Katar, insgesamt	843.292	2,77	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt				16.753.854	55,11	
RUMÄNIEN				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt				27.204.559	89,49		
USD	252.000	Romania (Govt of) 3.00% 27/02/2027	230.088	0,76	Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente						
USD	300.000	Romania (Govt of) 4.00% 14/02/2051	211.265	0,69	Anleihen						
USD	246.000	Romania (Govt of) 5.25% 25/11/2027	242.997	0,80	LUXEMBURG						
		Rumänien, insgesamt	684.350	2,25	USD	210.000	Hidrovias International Finance SARL 4.95% 08/02/2031	149.990	0,49		
SAUDI-ARABIEN				VENEZUELA							
USD	300.000	Saudi (Govt of) 3.45% 02/02/2061	213.411	0,70	USD	1.999.683	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	99.584	0,33		
USD	500.000	Saudi (Govt of) 3.75% 21/01/2055	387.805	1,28			Venezuela, insgesamt	99.584	0,33		
USD	285.000	Saudi (Govt of) 4.50% 26/10/2046	251.115	0,83	Anleihen, insgesamt				249.574	0,82	
USD	239.000	Saudi (Govt of) 4.88% 18/07/2033	243.062	0,80							
		Saudi-Arabien, insgesamt	1.095.393	3,61							
SÜDAFRIKA											
USD	500.000	South Africa (Govt of) 5.75% 30/09/2049	369.388	1,22							
		Südafrika, insgesamt	369.388	1,22							
TÜRKEI											
USD	430.000	Turkey (Govt of) 5.13% 17/02/2028	378.290	1,24							

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente (Fortsetzung)			
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente			
VENEZUELA			
USD	2.004.400	Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024	
		220.484	0,73
	Venezuela, insgesamt	220.484	0,73
	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt	220.484	0,73
	Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt	470.058	1,55
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Fonds			
IRLAND			
	1.596.398	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	
		1.596.398	5,25
	Irland, insgesamt	1.596.398	5,25
	Fonds, insgesamt	1.596.398	5,25
	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt	1.596.398	5,25
	Wert der Anlagen, insgesamt	29.271.015	96,29
	(Gesamtkosten: USD 36.073.701)		

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
BRASILIEN				INDIEN (Fortsetzung)					
USD	600.000	Light Servicos de Eletricidade SA 4.38% 18/06/2026	177.375	0,30	USD	600.000	JSW Steel Limited 5.95% 18/04/2024	593.831	0,99
		Brasilien, insgesamt	177.375	0,30	USD	700.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	585.905	0,98
KANADA				Indien, insgesamt					
USD	400.000	MEGlobal Canada ULC 5.00% 18/05/2025	397.688	0,66			1.786.111	2,98	
		Kanada, insgesamt	397.688	0,66	INDONESIEN				
KAIMANINSELN				INDONESIEN					
USD	600.000	CIFI Holdings Group Company Limited 0.00% 16/07/2025	128.306	0,21	USD	1.200.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 4.75% 15/05/2025	1.186.658	1,98
USD	700.000	Country Garden Holdings Company Limited 3.13% 22/10/2025	410.931	0,69	USD	700.000	Pertamina Persero PT 1.40% 09/02/2026	636.556	1,06
USD	975.000	Gaci First Investment Company 5.00% 13/10/2027	990.847	1,65	USD	1.200.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	45.000	0,08
USD	650.000	Meituan 3.05% 28/10/2030	520.657	0,87			Indonesien, insgesamt	1.868.214	3,12
USD	500.000	MGM China Holdings Limited 4.75% 01/02/2027	445.466	0,74	IRLAND				
USD	1.300.000	SA Global Sukuk Limited 1.60% 17/06/2026	1.192.945	1,99	USD	400.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	253.020	0,42
		Kaimaninseln, insgesamt	3.689.152	6,15	USD	300.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 3.05% 23/01/2025	225.427	0,38
GHANA				IRLAND					
USD	600.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	359.250	0,60			Irland, insgesamt	478.447	0,80
		Ghana, insgesamt	359.250	0,60	JERSEY - KANALINSELN				
GUATEMALA				JERSEY - KANALINSELN					
USD	820.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	756.382	1,26	USD	1.021.118	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 1.75% 30/09/2027	953.829	1,59
		Guatemala, insgesamt	756.382	1,26			Jersey - Kanalinseln, insgesamt	953.829	1,59
HONGKONG				KASACHSTAN					
USD	380.000	Lenovo Group Limited 5.83% 27/01/2028	383.706	0,64	USD	1.500.000	KazMunayGas National Company JSC 4.75% 24/04/2025	1.462.147	2,44
USD	500.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	504.619	0,84			Kasachstan, insgesamt	1.462.147	2,44
		Hongkong, insgesamt	888.325	1,48	LUXEMBURG				
INDIEN				LUXEMBURG					
USD	700.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	606.375	1,01	USD	500.000	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA 5.15% 11/02/2026	382.500	0,64
					USD	750.000	Millicom International Cellular SA 4.50% 27/04/2031	601.875	1,01
					USD	200.000	TMS Issuer Sarl 5.78% 23/08/2032	208.648	0,35
							Luxemburg, insgesamt	1.193.023	2,00

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
MAURITIUS				SAUDI-ARABIEN (Fortsetzung)					
USD	1.000.000	HTA Group Limited 7.00% 18/12/2025	951.875	1,59	USD	450.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	440.442	0,73
Mauritius, insgesamt			951.875	1,59	Saudi-Arabien, insgesamt			783.008	1,30
MEXIKO				SÜDAFRIKA					
USD	650.000	Cemex SAB de CV 7.38% 05/06/2027	671.483	1,12	USD	1.000.000	Eskom Holdings 6.75% 06/08/2023	993.685	1,65
USD	1.200.000	Petroleos Mexicanos 4.25% 15/01/2025	1.146.217	1,91	USD	300.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	295.660	0,49
USD	800.000	Petroleos Mexicanos 6.49% 23/01/2027	727.381	1,21	Südafrika, insgesamt			1.289.345	2,14
USD	800.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 16/10/2025	794.499	1,33	TÜRKEI				
USD	2.600.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 04/08/2026	2.471.366	4,12	USD	600.000	Turk Telekomunikasyon AS 6.88% 28/02/2025	578.244	0,96
Mexiko, insgesamt			5.810.946	9,69	Türkei, insgesamt			578.244	0,96
NIEDERLANDE				VEREINIGTES KÖNIGREICH					
USD	421.000	Braskem Netherlands Finance BV 7.25% 13/02/2033	406.772	0,68	USD	200.000	Nak Naftogaz Ukraine Via Kondor Finance plc 7.63% 08/11/2026	39.667	0,07
USD	883.600	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	795.240	1,33	Vereinigtes Königreich, insgesamt			39.667	0,07
USD	500.000	Metinvest BV 8.50% 23/04/2026	310.000	0,52	BRITISCHE JUNGFERNINSELN				
USD	1.000.000	Syngenta Finance NV 4.44% 24/04/2023	999.341	1,67	USD	800.000	Central American Bottling Corp. 5.25% 27/04/2029	743.980	1,24
Niederlande, insgesamt			2.511.353	4,20	USD	400.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	359.519	0,60
PERU				ANLEIHEN, INSGESAMT					
USD	800.000	Auna SAA 6.50% 20/11/2025	605.000	1,01	USD	1.000.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	998.548	1,67
Peru, insgesamt			605.000	1,01	USD	700.000	Studio City Finance Limited 6.00% 15/07/2025	651.463	1,09
PHILIPPINEN				BRITISCHE JUNGFERNINSELN, insgesamt					
USD	693.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	631.925	1,05	USD	700.000	Tsmc Global Limited 0.75% 28/09/2025	634.302	1,06
Philippinen, insgesamt			631.925	1,05	Britische Jungferninseln, insgesamt			3.387.812	5,66
KATAR				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente					
USD	700.000	QatarEnergy 1.38% 12/09/2026	635.858	1,06	ANGOLA				
Katar, insgesamt			635.858	1,06	USD	800.000	Angola (Govt of) 9.50% 12/11/2025	799.420	1,33
SAUDI-ARABIEN				Angola, insgesamt					
USD	350.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	342.566	0,57	Angola, insgesamt			799.420	1,33

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)						
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)						
BRASILIEN				INDONESIEN						
USD	1.500.000	Brazil (Govt of) 2.88% 06/06/2025	1.439.240	2,40	USD	640.000	Indonesia (Govt of) 4.55% 11/01/2028	641.636	1,07	
USD	400.000	Brazil (Govt of) 4.25% 07/01/2025	396.816	0,66	Indonesien, insgesamt					
Brasilien, insgesamt				1.836.056	3,06	641.636				1,07
KOLUMBIEN				MONGOLEI						
USD	500.000	Colombia (Govt of) 3.13% 15/04/2031	383.596	0,64	USD	200.000	Mongolia (Govt of) 8.65% 19/01/2028	197.219	0,33	
Kolumbien, insgesamt				383.596	0,64	MONGOLEI, insgesamt				
COSTA RICA				MAROKKO						
USD	300.000	Costa Rica (Govt of) 4.38% 30/04/2025	294.572	0,49	USD	320.000	Morocco (Govt of) 5.95% 08/03/2028	327.408	0,55	
Costa Rica, insgesamt				294.572	0,49	Marokko, insgesamt				
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				NIGERIA						
USD	1.000.000	Dominican Republic (Govt of) 5.50% 27/01/2025	991.605	1,65	USD	900.000	Nigeria (Govt of) 6.50% 28/11/2027	736.478	1,23	
USD	1.000.000	Dominican Republic (Govt of) 6.85% 29/01/2026	1.018.007	1,70	Nigeria, insgesamt					
Dominikanische Republik, insgesamt				2.009.612	3,35	736.478				1,23
ÄGYPTEN				OMAN						
USD	700.000	Egypt (Govt of) 3.88% 16/02/2026	519.808	0,87	USD	1.000.000	Oman (Govt of) 4.40% 01/06/2024	988.426	1,65	
USD	400.000	Egypt (Govt of) 5.25% 06/10/2025	318.359	0,53	USD	1.700.000	Oman (Govt of) 4.75% 15/06/2026	1.666.510	2,78	
USD	400.000	Egypt (Govt of) 5.80% 30/09/2027	282.259	0,47	Oman, insgesamt					
USD	1.300.000	Egypt (Govt of) 5.88% 11/06/2025	1.067.159	1,78	2.654.936				4,43	
Ägypten, insgesamt				2.187.585	3,65	PAKISTAN				
GHANA				PANAMA						
USD	700.000	Ghana (Govt of) 0.00% 11/02/2027	256.060	0,43	USD	1.350.000	Panama (Govt of) 3.75% 16/03/2025	1.321.121	2,20	
Ghana, insgesamt				256.060	0,43	Panama, insgesamt				
UNGARN				KATAR						
EUR	174.000	Hungary (Govt of) 5.00% 22/02/2027	190.574	0,32	USD	1.500.000	Qatar (Govt of) 3.25% 02/06/2026	1.465.470	2,45	
USD	307.000	Hungary (Govt of) 6.13% 22/05/2028	315.671	0,53	Katar, insgesamt					
Ungarn, insgesamt				506.245	0,85	1.465.470				2,45

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Anleihen					
RUMÄNIEN				VENEZUELA					
USD	646.000	Romania (Govt of) 3.00% 27/02/2027	589.829	0,98	USD	3.288.783	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 16/05/2024	153.619	0,26
		Rumänien, insgesamt	589.829	0,98	USD	491.751	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	24.489	0,04
SÜDAFRIKA				Venezuela, insgesamt					
USD	600.000	South Africa (Govt of) 4.30% 12/10/2028	540.765	0,90				178.108	0,30
USD	350.000	South Africa (Govt of) 4.85% 30/09/2029	315.428	0,53				178.108	0,30
		Südafrika, insgesamt	856.193	1,43	Anleihen, insgesamt				
SRI LANKA				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente					
USD	860.000	Sri Lanka (Govt of) 5.75% 18/04/2023	311.807	0,52	VENEZUELA				
		Sri Lanka, insgesamt	311.807	0,52	USD	1.245.400	Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024	136.994	0,23
TÜRKEI				Venezuela, insgesamt					
USD	1.200.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS 7.25% 24/02/2027	1.161.211	1,94				136.994	0,23
USD	1.100.000	Turkey (Govt of) 4.88% 09/10/2026	996.776	1,66	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt				
USD	2.000.000	Turkey (Govt of) 6.00% 25/03/2027	1.855.841	3,11				136.994	0,23
USD	935.000	Turkey (Govt of) 9.38% 14/03/2029	955.438	1,59	Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt				
		Türkei, insgesamt	4.969.266	8,30				315.102	0,53
UKRAINE				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren					
USD	2.534.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2026	484.628	0,81	Fonds				
		Ukraine, insgesamt	484.628	0,81	IRLAND				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt				Irland, insgesamt					
			23.094.140	38,54		2.809.014	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.809.014	4,69
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt				Fonds, insgesamt					
			54.329.116	90,65				2.809.014	4,69
				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt					
				Wert der Anlagen, insgesamt					
				(Gesamtkosten: USD 67.085.417)					
				<i>*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.</i>					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)			
BERMUDAS				KAIMANINSELN (Fortsetzung)			
USD	282.000 Nabors Industries Limited 7.25% 15/01/2026	269.310	0,23	USD	282.000 Transocean Titan Financing Limited 8.38% 01/02/2028	290.331	0,24
USD	55.000 Nabors Industries Limited 7.50% 15/01/2028	51.123	0,04	Kaimaninseln, insgesamt			
USD	246.000 NCL Corp. Limited 5.88% 15/03/2026	209.241	0,17	860.654 0,72			
Bermudas, insgesamt				529.674 0,44			
KANADA				FRANKREICH			
USD	570.000 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc. 3.88% 15/01/2028	530.456	0,44	USD	411.000 Altice France SA 5.13% 15/07/2029	310.305	0,26
USD	164.000 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc. 4.38% 15/01/2028	151.368	0,13	USD	311.000 Altice France SA 5.50% 15/01/2028	255.393	0,21
USD	55.000 1375209 BC Limited 9.00% 30/01/2028	54.725	0,05	USD	304.000 Altice France SA 5.50% 15/10/2029	231.800	0,19
USD	276.000 Air Canada 3.88% 15/08/2026	250.942	0,21	USD	160.000 Altice France SA 8.13% 01/02/2027	147.600	0,12
USD	164.000 Bausch Health Companys Inc. 6.13% 01/02/2027	106.551	0,09	USD	617.000 Constellium SE 3.75% 15/04/2029	535.248	0,45
USD	161.000 Bausch Health Cos Inc. 4.88% 01/06/2028	96.040	0,08	USD	346.000 Constellium SE 5.63% 15/06/2028	330.444	0,28
USD	167.000 Bausch Health Cos Inc. 5.50% 01/11/2025	139.504	0,12	USD	325.000 Iliad Holding SASU 6.50% 15/10/2026	312.078	0,26
USD	98.000 Bausch Health Cos Inc. 11.00% 30/09/2028	72.357	0,06	USD	679.000 Iliad Holding SASU 7.00% 15/10/2028	646.111	0,55
USD	19.000 Bausch Health Cos Inc. 14.00% 15/10/2030	10.878	0,01	Frankreich, insgesamt			
USD	349.000 Bombardier Inc. 7.88% 15/04/2027	353.714	0,30	2.768.979 2,32			
USD	166.000 Clarios Global LP 6.75% 15/05/2025	168.079	0,14	DEUTSCHLAND			
USD	843.000 Hudbay Minerals Inc. 4.50% 01/04/2026	785.538	0,65	USD	261.000 IHO Verwaltungs GmbH 4.75% 15/09/2026	234.732	0,20
USD	178.000 Hudbay Minerals Inc. 6.13% 01/04/2029	168.433	0,14	USD	384.000 IHO Verwaltungs GmbH 6.38% 15/05/2029	341.596	0,29
USD	316.000 Nova Chemicals Corp. 4.25% 15/05/2029	259.910	0,22	USD	261.000 TK Elevator Holdco GmbH 7.63% 15/07/2028	229.632	0,19
USD	268.000 Nova Chemicals Corp. 5.25% 01/06/2027	244.681	0,20	Deutschland, insgesamt			
USD	63.000 Ritchie Bros Holdings Inc. 6.75% 15/03/2028	64.919	0,05	805.960 0,68			
USD	142.000 Ritchie Bros Holdings Inc. 7.75% 15/03/2031	148.996	0,13	INTERNATIONALE ORGANISATIONEN			
Kanada, insgesamt				USD	207.000 Clarios Global LP 6.25% 15/05/2026	207.277	0,17
3.607.091 3,02				Internationale Organisationen, insgesamt			
				207.277 0,17			
KAIMANINSELN				IRLAND			
USD	601.627 Hawaiian Brand Intellectual Property Limited 5.75% 20/01/2026	570.323	0,48	USD	313.000 James Hardie International Finance Dac 5.00% 15/01/2028	295.150	0,25
				Irland, insgesamt			
				295.150 0,25			
				LIBERIA			
				USD	420.000 Royal Caribbean Cruises Limited 3.70% 15/03/2028	344.873	0,29

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Anleihen (Fortsetzung)				
LIBERIA (Fortsetzung)					PANAMA (Fortsetzung)				
USD	306.000	Royal Caribbean Cruises Limited 4.25% 01/07/2026	274.826	0,23	USD	660.000	Carnival Corp. 6.00% 01/05/2029	525.525	0,45
USD	179.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.38% 15/07/2027	159.869	0,13			Panama, insgesamt	1.183.706	1,00
USD	223.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.50% 31/08/2026	207.390	0,17			POLEN		
USD	42.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.50% 01/04/2028	37.154	0,03	USD	350.000	Canpack SA 3.88% 15/11/2029	288.400	0,24
USD	345.000	Royal Caribbean Cruises Limited 7.25% 15/01/2030	347.372	0,29			Polen, insgesamt	288.400	0,24
		Liberia, insgesamt	1.371.484	1,14			SPANIEN		
					USD	221.000	Grifols Escrow Issuer SA 4.75% 15/10/2028	181.773	0,15
							Spanien, insgesamt	181.773	0,15
LUXEMBURG					SUPRANATIONAL				
USD	284.000	Altice France Holding SA 6.00% 15/02/2028	181.429	0,15	USD	319.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 6.00% 15/06/2027	315.682	0,26
USD	280.000	Axalta Coating Systems LLC 4.75% 15/06/2027	266.756	0,22	USD	350.000	Clarios Global LP 8.50% 15/05/2027	351.969	0,29
USD	319.000	Camelot Finance SA 4.50% 01/11/2026	301.854	0,25			Supranational, insgesamt	667.651	0,55
USD	331.000	Fage International SA 5.63% 15/08/2026	310.844	0,26			VEREINIGTES KÖNIGREICH		
USD	422.000	Herens Holdco Sarl 4.75% 15/05/2028	337.864	0,28	USD	308.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 3.38% 15/01/2026	283.125	0,24
USD	440.000	Ion Trading Technologies Sarl 5.75% 15/05/2028	353.100	0,30	USD	215.000	International Game Technology plc 4.13% 15/04/2026	207.948	0,17
		Luxemburg, insgesamt	1.751.847	1,46	USD	140.000	International Game Technology plc P.P. 144A 6.50% 15/02/2025	141.575	0,12
NIEDERLANDE					USD	293.000	Virgin Media Finance plc 5.00% 15/07/2030	242.142	0,20
USD	187.000	Clear Channel International BV 6.63% 01/08/2025	183.026	0,15	USD	282.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.50% 15/08/2030	243.131	0,20
USD	193.000	Constellium SE 5.88% 15/02/2026	193.333	0,16	USD	237.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.50% 15/05/2029	220.825	0,18
USD	427.000	Trivium Packaging Finance BV 5.50% 15/08/2026	409.500	0,34	USD	631.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.25% 31/01/2031	535.062	0,45
USD	300.000	VZ Secured Financing BV 5.00% 15/01/2032	244.688	0,20			Vereinigtes Königreich, insgesamt	1.873.808	1,56
USD	178.000	Ziggo Bond Company BV 5.13% 28/02/2030	143.913	0,12	VEREINIGTE STAATEN				
USD	171.000	Ziggo Bond Finance BV 6.00% 15/01/2027	158.068	0,13	USD	354.000	Acadia Healthcare Company Inc. 5.00% 15/04/2029	333.203	0,28
USD	738.000	Ziggo BV 4.88% 15/01/2030	634.434	0,53	USD	76.000	Acadia Healthcare Company Inc. 5.50% 01/07/2028	73.673	0,06
		Niederlande, insgesamt	1.966.962	1,63	USD	534.000	AdaptHealth LLC 5.13% 01/03/2030	454.809	0,37
PANAMA									
USD	411.000	Carnival Corp. 4.00% 01/08/2028	354.488	0,30					
USD	367.000	Carnival Corp. 5.75% 01/03/2027	303.693	0,25					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
USD	390.000 AG TTMT Escrow Issuer LLC 8.63% 30/09/2027	393.811	0,33	USD	279.000 Avient Corp. 7.13% 01/08/2030	288.242	0,24
USD	353.000 Albertsons Companies Inc. 3.25% 15/03/2026	332.243	0,28	USD	180.000 Axalta Coating Systems LLC 3.38% 15/02/2029	156.600	0,13
USD	317.000 Albertsons Companies Inc. 5.88% 15/02/2028	315.371	0,26	USD	457.000 Bath & Body Works Inc. 6.63% 01/10/2030	446.091	0,37
USD	235.000 Alliant Holdings Intermediate LLC 4.25% 15/10/2027	210.452	0,18	USD	67.000 Bath & Body Works Inc. 6.88% 01/11/2035	60.875	0,05
USD	268.000 Alliant Holdings Intermediate LLC 5.88% 01/11/2029	227.381	0,19	USD	221.000 Bath & Body Works Inc. 7.50% 15/06/2029	226.025	0,19
USD	489.000 Alliant Holdings Intermediate LLC 6.75% 15/10/2027	455.063	0,38	USD	210.000 Beacon Roofing Supply Inc. 4.13% 15/05/2029	185.543	0,16
USD	604.000 Alliant Holdings Intermediate LLC 6.75% 15/04/2028	604.256	0,50	USD	196.000 Beacon Roofing Supply Inc. 4.50% 15/11/2026	185.955	0,16
USD	961.121 American Airlines Inc. 5.50% 20/04/2026	948.515	0,80	USD	334.000 Black Knight Infoserv LLC 3.63% 01/09/2028	303.312	0,25
USD	391.110 American Airlines Inc. 5.75% 20/04/2029	375.221	0,31	USD	346.000 Blackstone Mortgage Trust Inc. 3.75% 15/01/2027	274.922	0,23
USD	202.000 American Airlines Inc. 11.75% 15/07/2025	221.156	0,18	USD	275.000 Boyd Gaming Corp. 4.75% 15/06/2031	250.078	0,21
USD	316.000 American Builders & Contractors Supply Company Inc. 4.00% 15/01/2028	288.577	0,24	USD	350.000 BroadStreet Partners Inc. 5.88% 15/04/2029	299.548	0,25
USD	142.000 Apache Corp. 5.25% 01/02/2042	119.981	0,10	USD	291.000 BWX Technologies Inc. 4.13% 30/06/2028	264.901	0,22
USD	386.000 Arches Buyer Inc. 4.25% 01/06/2028	322.841	0,27	USD	663.000 Caesars Entertainment Inc. 4.63% 15/10/2029	582.263	0,49
USD	559.000 Arches Buyer Inc. 6.13% 01/12/2028	463.970	0,39	USD	529.000 Caesars Entertainment Inc. 6.25% 01/07/2025	529.529	0,45
USD	257.000 Archrock Partners LP Archrock Partners Finance Corp. 6.25% 01/04/2028	246.881	0,21	USD	531.000 Caesars Entertainment Inc. 7.00% 15/02/2030	541.288	0,45
USD	807.000 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 4.00% 01/09/2029	633.060	0,54	USD	453.000 Caesars Entertainment Inc. 8.13% 01/07/2027	462.626	0,39
USD	165.000 Asbury Automotive Group Inc. 4.63% 15/11/2029	147.778	0,12	USD	354.000 Caesars Resort Collection LLC 5.75% 01/07/2025	355.632	0,30
USD	262.000 Asbury Automotive Group Inc. 5.00% 15/02/2032	230.382	0,19	USD	280.000 Carnival Holdings Bermuda Limited 10.38% 01/05/2028	301.115	0,25
USD	405.000 Assuredpartners Inc. 5.63% 15/01/2029	349.414	0,29	USD	204.000 Catalent Pharma Solutions Inc. 3.13% 15/02/2029	180.158	0,15
USD	200.000 AssuredPartners Inc. 7.00% 15/08/2025	195.780	0,16	USD	343.000 CCO Holdings LLC 5.13% 01/05/2027	324.349	0,27
USD	557.000 AthenaHealth Group Inc. 6.50% 15/02/2030	453.097	0,38	USD	438.000 CCO Holdings LLC 4.25% 01/02/2031	361.624	0,30
USD	122.000 ATI Inc. 4.88% 01/10/2029	112.016	0,09	USD	755.000 CCO Holdings LLC 4.75% 01/03/2030	657.321	0,55
USD	506.000 ATI Inc. 5.13% 01/10/2031	461.093	0,39	USD	428.000 CCO Holdings LLC 4.75% 01/02/2032	360.055	0,30
USD	539.000 Avantor Funding Inc. 3.88% 01/11/2029	483.753	0,40	USD	479.000 CCO Holdings LLC 5.00% 01/02/2028	444.512	0,37
USD	162.000 Avantor Funding Inc. 4.63% 15/07/2028	154.001	0,13	USD	678.000 CD&R Smokey Buyer Inc. 6.75% 15/07/2025	584.351	0,49

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
USD	244.000 Cedar Fair LP/ Canada's Wonderland Company 5.50% 01/05/2025	243.948	0,20	USD	763.000 CrownRock LP 5.63% 15/10/2025	752.115	0,63
USD	313.000 Cengage Learning Inc. 9.50% 15/06/2024	302.734	0,25	USD	304.000 CSC Holdings LLC 3.38% 15/02/2031	211.280	0,18
USD	159.000 Charles River Laboratories International Inc. 3.75% 15/03/2029	142.705	0,12	USD	420.000 CSC Holdings LLC 4.13% 01/12/2030	304.500	0,25
USD	161.000 Charles River Laboratories International Inc. 4.25% 01/05/2028	150.650	0,13	USD	319.000 CSC Holdings LLC 4.63% 01/12/2030	157.108	0,13
USD	197.000 Chart Industries Inc. 7.50% 01/01/2030	203.425	0,17	USD	218.000 CSC Holdings LLC 5.00% 15/11/2031	109.436	0,09
USD	67.000 Chart Industries Inc. 9.50% 01/01/2031	70.834	0,06	USD	131.000 CSC Holdings LLC 5.38% 01/02/2028	108.299	0,09
USD	896.000 CHS/ Community Health Systems Inc. 5.25% 15/05/2030	687.679	0,57	USD	403.000 CSC Holdings LLC 6.50% 01/02/2029	334.490	0,28
USD	200.000 CHS/ Community Health Systems Inc. 6.88% 15/04/2029	123.730	0,10	USD	524.000 DISH DBS Corp. 5.75% 01/12/2028	391.577	0,33
USD	101.000 Cinemark USA Inc. 5.25% 15/07/2028	87.643	0,07	USD	741.000 DISH Network Corp. 11.75% 15/11/2027	713.675	0,61
USD	537.000 Cinemark USA Inc. 5.88% 15/03/2026	508.260	0,42	USD	535.000 DT Midstream Inc. 4.13% 15/06/2029	473.141	0,40
USD	314.000 Cinemark USA Inc. 8.75% 01/05/2025	322.243	0,27	USD	207.000 DT Midstream Inc. 4.38% 15/06/2031	180.782	0,15
USD	372.000 Clarivate Science Holdings Corp. 3.88% 01/07/2028	332.987	0,28	USD	354.000 Element Solutions Inc. 3.88% 01/09/2028	310.414	0,26
USD	528.000 Clarivate Science Holdings Corp. 4.88% 01/07/2029	477.837	0,40	USD	142.000 Encompass Health Corp. 4.50% 01/02/2028	132.505	0,11
USD	561.000 Clear Channel Outdoor Holdings Inc. 5.13% 15/08/2027	504.198	0,42	USD	330.000 Endeavor Energy Resources LP 5.75% 30/01/2028	327.938	0,27
USD	177.000 Clear Channel Outdoor Holdings Inc. 7.50% 01/06/2029	125.670	0,10	USD	623.000 Entegris Escrow Corp. 5.95% 15/06/2030	603.485	0,50
USD	521.000 Clear Channel Outdoor Holdings Inc. 7.75% 15/04/2028	391.076	0,33	USD	227.000 EQM Midstream Partner LP 4.50% 15/01/2029	193.234	0,16
USD	587.000 Clearway Energy Operating LLC 3.75% 15/02/2031	506.654	0,43	USD	799.000 EQM Midstream Partner LP 4.75% 15/01/2031	668.204	0,56
USD	173.000 Clearway Energy Operating LLC 3.75% 15/01/2032	145.184	0,12	USD	275.000 EQM Midstream Partner LP 5.50% 15/07/2028	251.218	0,21
USD	290.000 Clearway Energy Operating LLC 4.75% 15/03/2028	277.131	0,23	USD	369.000 EQM Midstream Partner LP 6.00% 01/07/2025	364.487	0,30
USD	677.000 Cloud Software Group Holdings Inc. 6.50% 31/03/2029	590.259	0,49	USD	118.000 EQM Midstream Partner LP 7.50% 01/06/2027	117.464	0,10
USD	317.000 CNX Midstream Partners LP 4.75% 15/04/2030	271.926	0,23	USD	281.000 Fertitta Entertainment LLC 6.75% 15/01/2030	231.363	0,19
USD	317.000 Cnx Resources Corp. 6.00% 15/01/2029	297.879	0,25	USD	328.000 Ford Motor Company 3.25% 12/02/2032	259.074	0,22
USD	138.000 CommScope Technologies LLC P.P. 144A 6.00% 15/06/2025	131.470	0,11	USD	385.000 Ford Motor Credit Company LLC 2.70% 10/08/2026	343.252	0,29
USD	274.000 CrownRock LP 5.00% 01/05/2029	254.902	0,21	USD	257.000 Ford Motor Credit Company LLC 2.90% 16/02/2028	221.097	0,18
				USD	402.000 Ford Motor Credit Company LLC 3.38% 13/11/2025	377.353	0,32

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
USD	414.000 Ford Motor Credit Company LLC 3.66% 08/09/2024	400.382	0,33	USD	188.000 Holly Energy Partners Corp. 6.38% 15/04/2027	187.754	0,16
USD	378.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.00% 13/11/2030	322.036	0,27	USD	343.000 HUB International Limited 5.63% 01/12/2029	299.268	0,25
USD	299.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.39% 08/01/2026	284.050	0,24	USD	494.000 HUB International Limited 7.00% 01/05/2026	488.896	0,41
USD	244.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.95% 28/05/2027	231.119	0,19	USD	391.000 iHeartCommunications Inc. 4.75% 15/01/2028	312.800	0,26
USD	486.000 Ford Motor Credit Company LLC 5.13% 16/06/2025	477.238	0,39	USD	282.000 iHeartCommunications Inc. 5.25% 15/08/2027	232.074	0,19
USD	279.000 Ford Motor Credit Company LLC 7.35% 04/11/2027	288.681	0,24	USD	249.000 Ingevity Corp. 3.88% 01/11/2028	215.976	0,18
USD	270.000 Frontier Communications Holdings LLC 8.63% 15/03/2031	265.059	0,22	USD	171.000 Interface Inc. 5.50% 01/12/2028	140.889	0,12
USD	214.000 Frontier Communications Holdings LLC 8.75% 15/05/2030	213.547	0,18	USD	344.000 IRB Holding Corp. 7.00% 15/06/2025	346.173	0,29
USD	735.000 Gates Global LLC 6.25% 15/01/2026	729.399	0,61	USD	237.000 Iron Mountain Inc. 5.00% 15/07/2028	220.677	0,18
USD	160.000 Goodyear Tire & Rubber Company 5.00% 15/07/2029	142.844	0,12	USD	299.000 Iron Mountain Inc. 5.25% 15/03/2028	284.137	0,24
USD	628.000 GoTo Group Inc 5.50% 01/09/2027	324.205	0,27	USD	145.000 ITT Holdings LLC 6.50% 01/08/2029	122.426	0,10
USD	275.000 Group 1 Automotive Inc. 4.00% 15/08/2028	242.254	0,20	USD	184.000 Kaiser Aluminum Corp. 4.50% 01/06/2031	151.631	0,13
USD	82.000 GTCR AP Finance Inc. 8.00% 15/05/2027	78.720	0,07	USD	161.000 Kaiser Aluminum Corp. 4.63% 01/03/2028	145.316	0,12
USD	466.000 H&E Equipment Services Inc. 3.88% 15/12/2028	410.318	0,34	USD	915.000 KAR Auction Services Inc. 5.13% 01/06/2025	904.135	0,76
USD	289.000 Hanesbrands Inc. 9.00% 15/02/2031	296.141	0,25	USD	200.000 Ladder Capital Finance Holdings LLLP 4.25% 01/02/2027	158.125	0,13
USD	329.000 HB Fuller Company 4.25% 15/10/2028	294.077	0,25	USD	772.000 Ladder Capital Finance Holdings LLLP 4.75% 15/06/2029	559.217	0,48
USD	135.000 HealthEquity Inc. 4.50% 01/10/2029	121.872	0,10	USD	371.000 Ladder Capital Finance Holdings LLLP 5.25% 01/10/2025	328.457	0,27
USD	486.000 Helios Software Holdings Inc. 4.63% 01/05/2028	397.305	0,33	USD	180.000 Lithia Motors Inc. 4.38% 15/01/2031	155.138	0,13
USD	307.000 Herc Holdings Inc. 5.50% 15/07/2027	296.831	0,25	USD	157.000 Live Nation Entertainment Inc. 4.75% 15/10/2027	145.870	0,12
USD	377.000 Hightower Holding LLC 6.75% 15/04/2029	321.106	0,27	USD	229.000 Live Nation Entertainment Inc. 4.88% 01/11/2024	224.563	0,19
USD	283.000 Hilcorp Energy I LP 5.75% 01/02/2029	263.190	0,22	USD	254.000 Live Nation Entertainment Inc. 6.50% 15/05/2027	257.016	0,21
USD	152.000 Hilcorp Energy I LP 6.00% 15/04/2030	141.514	0,12	USD	147.000 Madison IAQ LLC 4.13% 30/06/2028	128.032	0,11
USD	197.000 Hilcorp Energy I LP 6.25% 01/11/2028	189.136	0,16	USD	372.000 Madison IAQ LLC 5.88% 30/06/2029	287.919	0,24
USD	237.000 Hilcorp Energy I LP 6.25% 15/04/2032	220.366	0,18	USD	115.000 Match Group Holdings II LLC 3.63% 01/10/2031	93.498	0,08
USD	372.000 Holly Energy Partners Corp. 5.00% 01/02/2028	349.689	0,29	USD	463.000 Match Group Holdings II LLC 4.63% 01/06/2028	430.011	0,36
				USD	753.000 McAfee Corp. 7.38% 15/02/2030	630.167	0,53

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					
USD	67.000	Medline Borrower LP 3.88% 01/04/2029	58.164	0,05	USD	260.000	Olympus Water USA Holding Corp. 7.13% 01/10/2027	244.698	0,20
USD	800.000	Medline Borrower LP 5.25% 01/10/2029	695.165	0,58	USD	126.000	OneMain Finance Corp. 4.00% 15/09/2030	95.722	0,08
USD	416.000	Meritage Homes Corp. 3.88% 15/04/2029	369.460	0,31	USD	216.000	OneMain Finance Corp. 6.13% 15/03/2024	210.821	0,18
USD	214.000	Midwest Gaming Borrower LLC 4.88% 01/05/2029	186.407	0,16	USD	189.000	OneMain Finance Corp. 6.88% 15/03/2025	183.683	0,15
USD	403.299	Mileage Plus Holdings LLC 6.50% 20/06/2027	402.038	0,34	USD	375.000	Organon & Company 4.13% 30/04/2028	342.656	0,29
USD	170.000	Nabors Industries Inc. 7.38% 15/05/2027	166.439	0,14	USD	196.000	Outfront Media Capital LLC 4.25% 15/01/2029	166.257	0,14
USD	391.000	Navient Corp. 6.75% 25/06/2025	385.311	0,32	USD	229.000	Outfront Media Capital LLC 4.63% 15/03/2030	193.219	0,17
USD	175.000	NCR Corp 5.75% 01/09/2027	171.978	0,14	USD	273.000	Park Intermediate Holdings LLC 4.88% 15/05/2029	235.033	0,20
USD	120.000	NCR Corp 6.13% 01/09/2029	118.501	0,10	USD	395.000	Park Intermediate Holdings LLC 5.88% 01/10/2028	363.943	0,30
USD	759.000	NCR Corp. 5.00% 01/10/2028	671.525	0,56	USD	77.000	Park Intermediate Holdings LLC 7.50% 01/06/2025	77.529	0,06
USD	729.000	Neptune Bidco USA Inc. 9.29% 15/04/2029	678.134	0,57	USD	744.000	Permian Resources Operating LLC 5.88% 01/07/2029	703.544	0,59
USD	343.000	NextEra Energy Operating Partners 4.50% 15/09/2027	327.511	0,27	USD	73.000	Permian Resources Operating LLC 6.88% 01/04/2027	71.947	0,06
USD	337.000	NFP Corp. 4.88% 15/08/2028	307.170	0,26	USD	348.000	PetSmart Inc. 4.75% 15/02/2028	328.738	0,27
USD	878.000	NFP Corp. 6.88% 15/08/2028	762.764	0,63	USD	408.000	PetSmart Inc. 7.75% 15/02/2029	401.491	0,34
USD	402.000	NFP Corp. 7.50% 01/10/2030	393.625	0,33	USD	640.000	Post Holdings Inc. 4.63% 15/04/2030	574.000	0,48
USD	287.000	Novelis Corp. 3.25% 15/11/2026	263.155	0,22	USD	340.000	Post Holdings Inc. 5.75% 01/03/2027	334.875	0,28
USD	758.000	Novelis Corp. 4.75% 30/01/2030	696.886	0,58	USD	475.000	Primo Water Holdings Inc. 4.38% 30/04/2029	418.891	0,35
USD	147.000	NRG Energy Inc. 3.38% 15/02/2029	122.656	0,10	USD	628.000	Provident Funding Associates LP 6.38% 15/06/2025	557.727	0,47
USD	460.000	NRG Energy Inc. 3.63% 15/02/2031	373.951	0,32	USD	183.000	Radian Group Inc. 4.88% 15/03/2027	173.885	0,15
USD	247.000	NRG Energy Inc. 5.25% 15/06/2029	229.499	0,19	USD	291.000	Radian Group Inc. 6.63% 15/03/2025	289.810	0,24
USD	156.000	NRG Energy Inc. 5.75% 15/01/2028	152.983	0,13	USD	407.000	Radiate Holco LLC 4.50% 15/09/2026	318.986	0,27
USD	222.000	Nustar Logistics LP 5.75% 01/10/2025	217.331	0,18	USD	463.000	Radiate Holco LLC 6.50% 15/09/2028	191.566	0,16
USD	266.000	NuStar Logistics LP 5.63% 28/04/2027	253.840	0,21	USD	358.000	Resideo Funding Inc. 4.00% 01/09/2029	299.496	0,25
USD	578.000	NuStar Logistics LP 6.00% 01/06/2026	567.662	0,47	USD	129.000	RLJ Lodging Trust LP 3.75% 01/07/2026	119.229	0,10
USD	451.000	Occidental Petroleum Corp. 6.13% 01/01/2031	467.983	0,39	USD	569.000	Roblox Corp. 3.88% 01/05/2030	488.629	0,41
USD	435.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	459.728	0,38	USD	330.000	Rocket Mortgage LLC 3.63% 01/03/2029	282.975	0,24
USD	62.000	Occidental Petroleum Corp. 7.50% 01/05/2031	68.930	0,06					
USD	513.000	Olympus Water USA Holding Corp. 4.25% 01/10/2028	421.301	0,35					
USD	272.000	Olympus Water USA Holding Corp. 6.25% 01/10/2029	204.387	0,17					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
USD	247.000 Rocket Mortgage LLC 3.88% 01/03/2031	204.952	0,17	USD	168.000 Taylor Morrison Communities Inc. 5.88% 15/06/2027	166.442	0,14
USD	906.000 Rocket Mortgage LLC 4.00% 15/10/2033	721.493	0,59	USD	215.000 Tempo Acquisition LLC 5.75% 01/06/2025	215.525	0,18
USD	180.000 Sabre GBLB Inc. 7.38% 01/09/2025	160.898	0,13	USD	107.000 Tempur Sealy International 3.88% 15/10/2031	89.675	0,07
USD	137.000 Sabre GBLB Inc. 9.25% 15/04/2025	128.667	0,11	USD	233.000 Tenet Healthcare Corp. 6.13% 15/06/2030	230.117	0,19
USD	582.000 Scientific Games Holdings LP 6.63% 01/03/2030	515.070	0,43	USD	192.000 Terraform Power Operating LLC 5.00% 31/01/2028	185.312	0,15
USD	164.000 Scientific Games International Inc. 7.00% 15/05/2028	162.868	0,14	USD	529.000 TK Elevator US Newco Inc. 5.25% 15/07/2027	498.107	0,42
USD	622.000 Select Medical Corp. 6.25% 15/08/2026	604.117	0,50	USD	333.000 TransDigm Inc. 5.50% 15/11/2027	314.269	0,26
USD	362.000 Shift4 Payments LLC 4.63% 01/11/2026	341.786	0,29	USD	981.000 TransDigm Inc. 6.25% 15/03/2026	984.065	0,82
USD	290.000 Simmons Food Inc. 4.63% 01/03/2029	235.844	0,20	USD	217.000 TransDigm Inc. 6.38% 15/06/2026	214.020	0,18
USD	259.000 Sirius XM Radio Inc. 4.00% 15/07/2028	222.578	0,19	USD	296.000 TransDigm Inc. 6.75% 15/08/2028	299.145	0,25
USD	174.000 Sirius XM Radio Inc. 5.50% 01/07/2029	158.449	0,13	USD	1.024.000 Uber Technologies Inc. 4.50% 15/08/2029	936.916	0,78
USD	755.000 Southwestern Energy Company 4.75% 01/02/2032	666.470	0,56	USD	145.000 Uber Technologies Inc. 7.50% 15/05/2025	146.722	0,12
USD	206.000 Southwestern Energy Company 5.38% 01/02/2029	194.541	0,16	USD	201.000 United Airlines Inc. 4.38% 15/04/2026	192.834	0,16
USD	68.000 Southwestern Energy Company 5.70% 23/01/2025	68.000	0,06	USD	555.000 United Airlines Inc. 4.63% 15/04/2029	504.703	0,42
USD	199.000 Spectrum Brands Inc. 5.00% 01/10/2029	175.618	0,14	USD	279.000 Univision Communications Inc. 4.50% 01/05/2029	236.212	0,20
USD	64.000 Spectrum Brands Inc. 5.50% 15/07/2030	57.320	0,05	USD	235.000 Univision Communications Inc. 7.38% 30/06/2030	222.007	0,19
USD	230.000 Spectrum Brands Inc. 5.75% 15/07/2025	228.611	0,19	USD	162.000 US Foods Inc. 4.63% 01/06/2030	147.109	0,12
USD	177.000 Spirit AeroSystems Inc. 9.38% 30/11/2029	193.373	0,16	USD	399.000 US Foods Inc. 4.75% 15/02/2029	368.826	0,30
USD	133.000 SRS Distribution Inc. 4.63% 01/07/2028	117.967	0,10	USD	150.000 US Foods Inc. 6.25% 15/04/2025	151.412	0,13
USD	340.000 SRS Distribution Inc. 6.00% 01/12/2029	283.305	0,24	USD	335.000 USI Inc. 6.88% 01/05/2025	331.409	0,28
USD	519.000 SRS Distribution Inc. 6.13% 01/07/2029	438.231	0,37	USD	376.000 Venture Global Calcasieu Pass LLC 3.88% 15/08/2029	338.849	0,28
USD	202.000 Standard Industries Inc. 5.00% 15/02/2027	192.784	0,16	USD	612.000 Venture Global Calcasieu Pass LLC 3.88% 01/11/2033	516.213	0,43
USD	151.000 Staples Inc. 7.50% 15/04/2026	132.347	0,11	USD	363.000 Venture Global Calcasieu Pass LLC 4.13% 15/08/2031	319.378	0,27
USD	210.000 Surgery Center Holdings Inc. 6.75% 01/07/2025	208.967	0,17	USD	436.000 Vercend Escrow Corp. 9.75% 15/08/2026	438.945	0,37
USD	200.000 Taylor Morrison Communities Inc. 5.75% 15/01/2028	197.484	0,16	USD	82.000 Vistra Operations Company LLC 4.38% 01/05/2029	73.050	0,06
				USD	222.000 Vistra Operations Company LLC 5.50% 01/09/2026	215.340	0,18
				USD	353.000 Vistra Operations Company LLC 5.63% 15/02/2027	343.443	0,29

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
USD	612.000 Waste Pro USA Inc. 5.50% 15/02/2026	563.078	0,47	USD	637.000 DISH DBS Corp. 5.13% 01/06/2029	337.610	0,28
USD	233.000 Wesco Distribution Inc. 7.13% 15/06/2025	237.112	0,20	USD	243.000 DISH DBS Corp. 7.75% 01/07/2026	160.836	0,13
USD	635.000 Wesco Distribution Inc. 7.25% 15/06/2028	651.669	0,54	USD	608.757 iHeartCommunications Inc. 8.38% 01/05/2027	445.063	0,37
USD	171.000 Western Midstream Operating LP 4.30% 01/02/2030	156.359	0,13	USD	418.000 Matador Resources Company 5.88% 15/09/2026	412.930	0,35
USD	331.000 Western Midstream Operating LP 4.65% 01/07/2026	321.009	0,27	USD	119.000 Newell Brands Inc. 6.38% 15/09/2027	120.226	0,10
USD	619.000 White Cap Buyer LLC 6.88% 15/10/2028	540.210	0,45	USD	167.000 Newell Brands Inc. 6.63% 15/09/2029	168.955	0,14
USD	206.000 Wolverine World Wide Inc. 4.00% 15/08/2029	167.612	0,14	USD	428.000 Occidental Petroleum Corp. 6.45% 15/09/2036	448.598	0,37
USD	489.000 WR Grace Holdings LLC 4.88% 15/06/2027	472.574	0,39	USD	137.000 Occidental Petroleum Corp. 6.60% 15/03/2046	144.364	0,12
USD	852.000 WR Grace Holdings LLC 5.63% 15/08/2029	722.851	0,61	USD	447.000 Pilgrim's Pride Corp. 3.50% 01/03/2032	364.607	0,30
USD	166.000 WR Grace Holdings LLC 7.38% 01/03/2031	166.841	0,14	USD	265.000 Pilgrim's Pride Corp. 4.25% 15/04/2031	233.908	0,20
USD	373.000 Yum! Brands Inc. 5.38% 01/04/2032	360.842	0,30	USD	200.000 Scotts Miracle-Gro Company 4.00% 01/04/2031	160.779	0,14
USD	99.000 Zayo Group Holdings Inc. 4.00% 01/03/2027	75.549	0,06	USD	185.000 Scotts Miracle-Gro CoThe 4.38% 01/02/2032	149.532	0,12
USD	690.000 ZoomInfo Technologies LLC 3.88% 01/02/2029	599.438	0,51	USD	244.000 Sunoco LP Sunoco Finance Corp. 5.88% 15/03/2028	238.998	0,20
	Vereinigte Staaten, insgesamt	86.465.215	72,24	USD	415.000 Tenet Healthcare Corp. 4.88% 01/01/2026	407.628	0,34
	Anleihen, insgesamt	104.825.631	87,57	USD	275.000 Tenet Healthcare Corp. 5.13% 01/11/2027	265.729	0,22
	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	104.825.631	87,57	USD	399.000 Tenet Healthcare Corp. 6.13% 01/10/2028	381.793	0,32
	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere			USD	736.000 Tenet Healthcare Corp. 6.25% 01/02/2027	727.121	0,62
	Anleihen			USD	619.000 TransMontaigne Partners LP 6.13% 15/02/2026	535.951	0,45
				USD	317.000 USA Compression Partners LP 6.88% 01/04/2026	312.994	0,26
					Vereinigte Staaten, insgesamt	7.219.137	6,04
	VEREINIGTE STAATEN				Anleihen, insgesamt	7.219.137	6,04
USD	622.000 Callon Petroleum Company 6.38% 01/07/2026	595.732	0,50		Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt	7.219.137	6,04
USD	188.000 CCO Holdings LLC 4.50% 01/05/2032	153.690	0,13				
USD	272.000 Cedar Fair LP/ Canada's Wonderland Company 6.50% 01/10/2028	265.200	0,22				
USD	189.000 Delek Logistics Partners LP 6.75% 15/05/2025	186.893	0,16				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				
Anleihen				
LUXEMBURG				
USD	142.000	Altice France Holding SA 10.50% 15/05/2027	108.808	0,09
		Luxemburg, insgesamt	108.808	0,09
VEREINIGTE STAATEN				
USD	196.000	Illuminate Buyer LLC 9.00% 01/07/2028	177.380	0,15
USD	357.000	Innophos Holdings Inc. 9.38% 15/02/2028	365.416	0,31
USD	219.000	Iris Holdings Inc. 8.75% 15/02/2026	204.628	0,17
		Vereinigte Staaten, insgesamt	747.424	0,63
		Anleihen, insgesamt	856.232	0,72
		Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt	856.232	0,72
		Wert der Anlagen, insgesamt	112.901.000	94,33
(Gesamtkosten: USD 124.022.245)				

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
BAHAMAS				KAIMANINSELN (Fortsetzung)					
USD	200.000	Competition Team Technologies Limited 3.75% 12/03/2024	197.311	0,46	USD	400.000	Tencent Holdings Limited 2.88% 22/04/2031	344.947	0,80
		Bahamas, insgesamt	197.311	0,46	USD	600.000	Times China Holdings Limited 0.00% 16/07/2023	92.750	0,22
KAIMANINSELN				HONGKONG					
USD	250.000	AAC Technologies Holdings Inc. 3.00% 27/11/2024	232.975	0,54	USD	400.000	Bank of East Asia Limited FRN 29/05/2030	366.277	0,85
USD	250.000	Alibaba Group Holding Limited 4.50% 28/11/2034	235.151	0,55	USD	260.000	Lenovo Group Limited 3.42% 02/11/2030	218.010	0,51
USD	500.000	China Mengniu Dairy Company Limited 1.88% 17/06/2025	466.169	1,08	USD	485.000	Lenovo Group Limited 6.54% 27/07/2032	491.489	1,14
USD	600.000	CIFI Holdings Group Company Limited 0.00% 16/07/2025	128.306	0,30	USD	500.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	379.944	0,88
USD	600.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	567.434	1,32			Kaimaninseln, insgesamt	6.871.467	15,97
USD	200.000	Country Garden Holdings Company Limited 2.70% 12/07/2026	110.222	0,26			Hongkong, insgesamt	1.455.720	3,38
USD	460.000	Country Garden Holdings Company Limited 3.13% 22/10/2025	270.040	0,63	INDIEN				
USD	200.000	Country Garden Holdings Company Limited 5.40% 27/05/2025	132.289	0,31	USD	400.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	287.500	0,67
USD	500.000	ENN Energy Holdings Limited 2.63% 17/09/2030	419.158	0,97	USD	280.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	242.550	0,56
USD	400.000	Goodman HK Finance 3.00% 22/07/2030	342.638	0,80	USD	300.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 3.10% 02/02/2031	195.961	0,46
USD	500.000	HPHT Finance 19 Limited 2.88% 05/11/2024	483.107	1,12	USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	158.675	0,37
USD	1.000.000	Logan Group Company Limited 0.00% 06/07/2026	232.745	0,54	USD	400.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	306.024	0,71
USD	200.000	Longfor Group Holdings Limited 3.95% 16/09/2029	150.533	0,35	USD	400.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	351.304	0,82
USD	400.000	Longfor Group Holdings Limited 4.50% 16/01/2028	332.116	0,77	USD	226.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.75% 02/02/2026	211.796	0,49
USD	800.000	Meituan 3.05% 28/10/2030	640.809	1,49	USD	500.000	Ongc Videsh Limited 4.63% 15/07/2024	495.399	1,15
USD	500.000	Melco Resorts Finance Limited 4.88% 06/06/2025	469.846	1,09	USD	500.000	Reliance Industries Limited 3.67% 30/11/2027	470.537	1,09
USD	300.000	MGM China Holdings Limited 4.75% 01/02/2027	267.280	0,62	USD	490.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	410.133	0,95
USD	250.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Limited 2.75% 13/05/2030	220.569	0,51			Indien, insgesamt	3.129.879	7,27
USD	270.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Limited 3.75% 25/02/2029	255.463	0,59					
USD	200.000	Sunac China Holdings Limited 6.50% 09/07/2023	48.361	0,11					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
INDONESIEN				PHILIPPINEN					
USD	400.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.80% 15/05/2050	359.265	0,84	USD	400.000	Globe Telecom Inc. 2.50% 23/07/2030	321.152	0,75
USD	400.000	Pertamina Persero PT 5.63% 20/05/2043	380.873	0,89	USD	520.000	Globe Telecom Inc. - Perp FRN	477.805	1,11
USD	200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT 5.25% 24/10/2042	176.125	0,41	USD	200.000	International Container Terminal Services Inc. 4.75% 17/06/2030	188.513	0,44
USD	200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT 6.25% 25/01/2049	194.963	0,45	USD	714.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	651.074	1,51
USD	400.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	15.000	0,03	USD	470.000	SMC Global Power Holdings Corp. Perp FRN	385.769	0,90
		Indonesien, insgesamt	1.126.226	2,62			Philippinen, insgesamt	2.024.313	4,71
INSEL MAN				SÜDKOREA					
USD	400.000	Gohl Capital Limited 4.25% 24/01/2027	368.502	0,86	USD	500.000	Shinhan Financial Group Company Limited Perp FRN	497.153	1,15
		Insel Man, insgesamt	368.502	0,86	USD	400.000	SK Hynix Inc. 6.50% 17/01/2033	392.572	0,91
							Südkorea, insgesamt	889.725	2,06
MALAYSIA				SINGAPUR					
USD	200.000	Axiata SPV2 Bhd 4.36% 24/03/2026	197.267	0,46	USD	300.000	ABJA Investment Company 5.45% 24/01/2028	291.496	0,68
USD	500.000	Petronas Capital Limited 3.50% 21/04/2030	467.832	1,09	USD	400.000	BOC Aviation Limited 2.63% 17/09/2030	342.313	0,80
USD	720.000	Petronas Capital Limited 4.55% 21/04/2050	673.241	1,56	USD	550.000	DBS Group Holdings Limited FRN 11/12/2028	547.122	1,27
USD	400.000	TNB Global Ventures Capital Bhd 4.85% 01/11/2028	399.092	0,93	USD	700.000	SingTel Group Treasury Pte Limited 1.88% 10/06/2030	588.780	1,37
		Malaysia, insgesamt	1.737.432	4,04	USD	550.000	United Overseas Bank Limited FRN 16/03/2031	492.780	1,15
							Singapur, insgesamt	2.262.491	5,27
MAURITIUS				THAILAND					
USD	400.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	385.588	0,90	USD	800.000	Bangkok Bank plc FRN 25/09/2034	681.857	1,58
USD	469.000	Network I2i Limited Perp FRN	443.965	1,03	USD	270.000	GC Treasury Center Company Limited 4.30% 18/03/2051	196.003	0,46
		Mauritius, insgesamt	829.553	1,93	USD	200.000	GCTreasury Centre Company 2.98% 18/03/2031	164.568	0,38
NIEDERLANDE				VEREINIGTES KÖNIGREICH					
USD	526.400	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	473.760	1,10	USD	600.000	Standard Chartered plc FRN 26/01/2169	557.499	1,30
USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	214.250	0,50					
USD	500.000	Royal Capital BV FRN 05/05/2169	484.346	1,13					
		Niederlande, insgesamt	1.172.356	2,73					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				INDONESIEN					
USD	400.000	Vedanta Resources plc 6.13% 09/08/2024	237.550	0,55	USD	500.000	Indonesia (Govt of) 3.05% 12/03/2051	370.472	0,86
		Vereinigtes Königreich, insgesamt	795.049	1,85	USD	500.000	Indonesia (Govt of) 3.20% 23/09/2061	349.110	0,81
BRITISCHE JUNGFERNINSELN									
USD	500.000	CMHI Finance [BVI] Company - Perp FRN	495.105	1,14	USD	800.000	Indonesia (Govt of) 3.40% 18/09/2029	749.198	1,74
USD	500.000	CNPC Global Capital Limited 1.35% 23/06/2025	462.733	1,08	USD	1.000.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 11/02/2029	1.011.528	2,36
USD	450.000	Contemporary Ruiding Development Limited 2.63% 17/09/2030	382.475	0,89	USD	200.000	Indonesia (Govt of) 6.63% 17/02/2037	230.533	0,54
USD	600.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	539.278	1,25	USD	200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.30% 23/06/2025	190.963	0,44
USD	750.000	FPC Resources Limited 4.38% 11/09/2027	699.342	1,62	Indonesien, insgesamt				
USD	511.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	456.896	1,06	2.901.804 6,75				
USD	500.000	Hongkong Electric Finance Limited 1.88% 27/08/2030	411.321	0,96	MONGOLEI				
USD	1.000.000	JGSH Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	900.477	2,09	USD	200.000	Mongolia (Govt of) 8.65% 19/01/2028	197.219	0,46
USD	300.000	Nan Fung Treasury Limited 5.00% 05/09/2028	289.045	0,67	MONGOLEI, insgesamt				
USD	340.000	State Grid Overseas Investment BVI Limited 1.63% 05/08/2030	280.767	0,65	197.219 0,46				
USD	500.000	Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	385.000	0,89	PAKISTAN				
USD	400.000	Studio City Finance Limited 6.00% 15/07/2025	372.265	0,87	USD	350.000	Pakistan (Govt of) 6.00% 08/04/2026	130.377	0,30
USD	850.000	Tsmc Global Limited 0.75% 28/09/2025	770.224	1,79	USD	200.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 30/09/2025	78.750	0,18
USD	400.000	Yongda Investment Limited 2.25% 16/06/2025	374.209	0,87	Pakistan, insgesamt				
Britische Jungferninseln, insgesamt				209.127 0,48					
Anleihen, insgesamt				31.074.344 72,22					
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				PHILIPPINEN					
				INDIEN					
USD	400.000	Export-Import Bank of India 3.25% 15/01/2030	353.054	0,82	USD	1.000.000	Philippine (Govt of) 3.00% 01/02/2028	942.746	2,19
Indien, insgesamt				353.054 0,82					
				SRI LANKA					
				USD					
				420.000					
				Sri Lanka (Govt of) 5.75% 18/04/2023					
				152.278					
				0,35					
				Sri Lanka, insgesamt					
				152.278 0,35					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)			
BRITISCHE JUNGFERNINSELN			
USD	500.000 Talent Yield International Limited 3.13% 06/05/2031	439.135	1,02
	Britische Jungferninseln, insgesamt	439.135	1,02
	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt	5.580.566	12,97
	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	36.654.910	85,19
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
Anleihen			
KAIMANINSELN			
USD	450.000 Sunac China Holdings Limited 8.35% 19/04/2023	108.995	0,25
	Kaimaninseln, insgesamt	108.995	0,25
	Anleihen, insgesamt	108.995	0,25
	Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt	108.995	0,25
	Wert der Anlagen, insgesamt	36.763.905	85,44
(Gesamtkosten: USD 43.946.784)			

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung					Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente					Fonds				
DEUTSCHLAND					IRLAND				
EUR	60.000	Germany (Govt of) 0.00% 17/05/2023	59.808	14,66	36	iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	5.448	1,34	
		Deutschland, insgesamt	59.808	14,66	82	iShares Core S&P 500 UCITS ETF	31.972	7,84	
					671	iShares MSCI EM UCITS ETF USD Acc	21.324	5,23	
					3.005	iShares plc - iShares Core FTSE 100 UCITS ETF	25.618	6,28	
					807	Vanguard FTSE Japan UCITS ETF	23.032	5,65	
						Irland, insgesamt	107.394	26,34	
					LUXEMBURG				
					1.340	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities XU**	25.696	6,30	
					3.367	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond 4E**	32.524	7,97	
					226	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond 4E**	2.395	0,59	
					371	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond XE**	38.923	9,54	
					490	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds XU**	4.730	1,16	
					2.612	Threadneedle (Lux) - Global Focus XU**	55.027	13,48	
					3.219	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities XE**	32.503	7,97	
					790	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies 4E**	8.712	2,14	
						Luxemburg, insgesamt	200.510	49,15	
						Fonds, insgesamt	307.904	75,49	
					Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt				
							307.904	75,49	
					Strukturierte Instrumente - Rohstoffe				
					IRLAND				
	11	Invesco Physical Gold ETC 0.00%	1.935	0,47					
		Irland, insgesamt	1.935	0,47					
		Strukturierte Instrumente - Rohstoffe, insgesamt	1.935	0,47					
					Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt				
			133.330	32,68					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Sonstige Organismen für gemeinsame Anlagen			
Fonds			
VEREINIGTES KÖNIGREICH			
	– CT European Fund***	0	0,00
	– CT European Select Fund***	0	0,00
	– CT Japan Fund***	0	0,00
	Vereinigtes Königreich, insgesamt	0	0,00
	Fonds, insgesamt	0	0,00
	Sonstige Organismen für gemeinsame Anlagen, insgesamt	0	0,00
	Wert der Anlagen, insgesamt	441.234	108,17
	(Gesamtkosten: EUR 421.736)		

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

**Siehe Erläuterung 18.

***Verbundener Fonds, Bruchteil auf null abgerundet.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				Aktien (Fortsetzung)			
MEXIKO				FRANKREICH			
USD	660.000 Mexico (Govt of) 5.75% 12/10/2110	593.802	1,66	5.662	AXA SA	173.256	0,48
				907	EssilorLuxottica SA	163.578	0,46
				516	L'Oreal SA	230.550	0,64
	Mexiko, insgesamt	593.802	1,66	235	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	215.589	0,61
				1.533	Schneider Electric SE	255.958	0,72
				8.663	TotalEnergies SE	511.632	1,43
					Frankreich, insgesamt	1.550.563	4,34
VEREINIGTES KÖNIGREICH				DEUTSCHLAND			
GBP	87.000 United Kingdom Gilt 1.25% 31/07/2051	60.270	0,17	738	Adidas AG	130.517	0,36
GBP	600.000 United Kingdom Inflation- Linked Gilt 0.15% 22/03/2051	842.399	2,36		Deutschland, insgesamt	130.517	0,36
	Vereinigtes Königreich, insgesamt	902.669	2,53	HONGKONG			
				23.200	AIA Group Limited	244.266	0,69
					Hongkong, insgesamt	244.266	0,69
VEREINIGTE STAATEN				INDIEN			
USD	2.350.000 United States Treasury Bill 0.00% 16/05/2023	2.337.179	6,53	5.500	HDFC Bank Limited - ADR	366.685	1,03
USD	1.200.000 United States Treasury N/B 1.88% 15/02/2032	1.053.562	2,95	6.929	Kotak Mahindra Bank Limited	146.100	0,41
USD	2.618.000 United States Treasury N/B 2.88% 15/05/2032	2.492.009	6,96		Indien, insgesamt	512.785	1,44
USD	1.505.000 United States Treasury N/B 3.00% 15/08/2052	1.321.931	3,70	INDONESIEN			
USD	1.775.200 United States Treasury N/B 3.38% 15/08/2042	1.668.827	4,67	829.150	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	261.550	0,73
USD	1.850.000 United States Treasury N/B 3.88% 30/11/2027	1.869.512	5,23		Indonesien, insgesamt	261.550	0,73
	Vereinigte Staaten, insgesamt	10.743.020	30,04	IRLAND			
				2.813	CRH plc	142.036	0,40
				840	Linde plc	298.569	0,84
					Irland, insgesamt	440.605	1,24
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt				JAPAN			
		12.239.491	34,23	600	Keyence Corp.	290.555	0,81
				3.600	Recruit Holdings Company Limited	98.730	0,28
				2.000	Sony Group Corp.	180.104	0,50
					Japan, insgesamt	569.389	1,59
Aktien				NIEDERLANDE			
AUSTRALIEN				1.135	Koninklijke DSM NV	134.040	0,37
969	CSL Limited	187.103	0,52		Niederlande, insgesamt	134.040	0,37
	Australien, insgesamt	187.103	0,52	DÄNEMARK			
KANADA				1.308	Novo Nordisk AS	207.134	0,58
2.068	Nutrien Limited	152.516	0,43	2.406	Orsted A/S	204.718	0,57
	Kanada, insgesamt	152.516	0,43		Dänemark, insgesamt	411.852	1,15

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)					
NORWEGEN				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					
6.643	Equinor ASA	189.463	0,53	470	Elevance Health Inc.	216.111	0,60		
	Norwegen, insgesamt	189.463	0,53	1.026	Eli Lilly & Company	352.349	0,99		
SÜDKOREA				238	Equinix Inc.	171.608	0,48		
377	Samsung Sdi Company Limited	212.848	0,60	1.697	IntercontinentalExchange Inc.	176.980	0,49		
	Südkorea, insgesamt	212.848	0,60	873	Intuit Inc.	389.210	1,09		
SINGAPUR				2.906	JPMorgan Chase & Company	378.682	1,05		
10.300	DBS Group Holdings Limited	255.650	0,71	508	Lam Research Corp.	269.301	0,75		
	Singapur, insgesamt	255.650	0,71	1.582	Mastercard Inc. - A	574.915	1,61		
SCHWEIZ				160	Mercadolibre Inc.	210.890	0,59		
295	Lonza Group AG - Reg	176.764	0,49	3.249	Micron Technology Inc.	196.045	0,55		
2.776	Nestle SA - Reg	338.693	0,95	3.484	Microsoft Corp.	1.004.437	2,80		
	Schweiz, insgesamt	515.457	1,44	3.102	NextEra Energy Inc.	239.102	0,68		
TAIWAN				913	NVIDIA Corp.	253.604	0,71		
23.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	402.622	1,12	2.220	ON Semiconductor Corp.	182.750	0,51		
	Taiwan, insgesamt	402.622	1,12	1.585	Paypal Holdings Inc.	120.365	0,34		
VEREINIGTES KÖNIGREICH				1.638	PepsiCo Inc.	298.607	0,83		
4.557	Anglo American plc	150.892	0,42	2.270	QUALCOMM Inc.	289.607	0,81		
5.402	Diageo plc	241.390	0,68	669	Stryker Corp.	190.979	0,54		
8.461	Shell plc	241.506	0,68	488	Thermo Fisher Scientific Inc.	281.269	0,79		
5.043	SSE plc	112.425	0,31	3.508	T-Mobile USA Inc.	508.099	1,42		
	Vereinigtes Königreich, insgesamt	746.213	2,09	3.348	Trimble Inc.	175.502	0,49		
VEREINIGTE STAATEN				7.433	Uber Technologies Inc.	235.626	0,66		
1.703	Abbott Laboratories	172.446	0,48	1.200	Union Pacific Corp.	241.512	0,68		
623	Adobe Inc.	240.086	0,67	1.902	Walt Disney Company	190.447	0,53		
1.761	Advanced Micro Devices Inc.	172.596	0,48	Vereinigte Staaten, insgesamt			10.287.107	28,76	
7.152	Alphabet Inc. - A	741.877	2,07	Aktien, insgesamt				17.204.546	48,11
6.203	Amazon.com Inc.	640.707	1,79	Strukturierte Instrumente - Rohstoffe					
750	Autodesk Inc.	156.120	0,44	IRLAND					
511	Cooper Companies Inc.	190.787	0,53	1.035	Invesco Physical Gold ETC 0.00%	197.789	0,55		
869	CrowdStrike Holdings Inc. - A	119.279	0,33	Irland, insgesamt			197.789	0,55	
407	Deere & Company	168.042	0,47	Strukturierte Instrumente - Rohstoffe, insgesamt				197.789	0,55
1.784	Ecolab Inc.	295.306	0,83	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt				29.641.826	82,89
2.008	Electronic Arts Inc.	241.864	0,68						

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Fonds			
LUXEMBURG			
90.494	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio XU**	1.885.062	5,27
	Luxemburg, insgesamt	1.885.062	5,27
	Fonds, insgesamt	1.885.062	5,27
	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt	1.885.062	5,27
Sonstige Organismen für gemeinsame Anlagen			
Fonds			
VEREINIGTES KÖNIGREICH			
309.138	CT Emerging Market Local Fund***	884.474	2,48
	Vereinigtes Königreich, insgesamt	884.474	2,48
	Fonds, insgesamt	884.474	2,48
	Sonstige Organismen für gemeinsame Anlagen, insgesamt	884.474	2,48
	Wert der Anlagen, insgesamt	32.411.362	90,64
(Gesamtkosten: USD 28.868.926)			

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

**Siehe Erläuterung 18.

***Fonds der verbundenen Partei.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
AUSTRALIEN				FINNLAND					
EUR	100.000	APA Infrastructure Limited 0.75% 15/03/2029	88.981	0,08	EUR	100.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	92.125	0,08
USD	77.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	73.348	0,07	EUR	100.000	Teollisuuden Voima Oyj 1.38% 23/06/2028	93.134	0,09
EUR	100.000	NBN Company Limited 4.13% 15/03/2029	111.159	0,10	EUR	100.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.63% 31/03/2027	101.958	0,09
USD	97.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	93.652	0,09			Finnland, insgesamt	287.217	0,26
		Australien, insgesamt	367.140	0,34			FRANKREICH		
BELGIEN				FRANKREICH					
EUR	100.000	Azelis Finance NV 5.75% 15/03/2028	110.275	0,10	EUR	100.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	101.493	0,09
EUR	100.000	Solvay SA FRN 02/03/2169	97.454	0,09	EUR	100.000	Altice France SA 4.00% 15/07/2029	81.781	0,07
EUR	100.000	Solvay SA Perp FRN 04/03/2168	108.089	0,10	EUR	100.000	Altice France SA 4.13% 15/01/2029	84.053	0,08
		Belgien, insgesamt	315.818	0,29	EUR	104.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	85.196	0,08
BERMUDAS				BERMUDAS					
USD	100.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	93.753	0,09	EUR	100.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	96.287	0,09
		Bermudas, insgesamt	93.753	0,09	USD	200.000	BNP Paribas SA FRN 13/01/2029	200.138	0,19
KANADA				KANADA					
USD	31.000	Enbridge Inc. 5.70% 08/03/2033	32.289	0,03	EUR	100.000	BPCE SA 0.25% 14/01/2031	82.080	0,07
EUR	172.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	163.040	0,15	EUR	192.000	CAB Selas 3.38% 01/02/2028	171.782	0,16
		Kanada, insgesamt	195.329	0,18	EUR	107.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	35.718	0,03
KAIMANINSELN				KAIMANINSELN					
GBP	112.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	119.953	0,11	EUR	200.000	Electricite de France SA FRN 01/06/2170	172.973	0,16
		Kaimaninseln, insgesamt	119.953	0,11	EUR	200.000	Electricite de France SA FRN 15/03/2169	182.711	0,17
TSCHECHISCHE REPUBLIK				TSCHECHISCHE REPUBLIK					
EUR	100.000	Allwyn International AS 4.13% 20/11/2024	107.092	0,10	EUR	200.000	Electricite de France SA 4.25% 25/01/2032	215.781	0,20
		Tschechische Republik, insgesamt	107.092	0,10	EUR	100.000	Electricite de France SA FRN 22/01/2049	100.586	0,09
DÄNEMARK				DÄNEMARK					
EUR	100.000	Danske Bank AS 0.63% 26/05/2025	101.540	0,09	EUR	100.000	Electricite de France SA FRN 29/12/2049	104.151	0,10
		Dänemark, insgesamt	101.540	0,09	GBP	200.000	Electricite de France SA FRN 31/12/2049	205.790	0,19
					EUR	100.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	95.409	0,09
					EUR	100.000	Emeria SASU 7.75% 31/03/2028	103.379	0,10
					EUR	150.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2027	142.568	0,13
					EUR	187.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	181.144	0,17
					EUR	100.000	Faurecia SE 3.75% 15/06/2028	97.594	0,09
					EUR	100.000	Faurecia SE 7.25% 15/06/2026	112.289	0,10
					EUR	105.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	110.920	0,10
					EUR	317.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	332.551	0,31
					EUR	100.000	Iliad Holding SASU 5.63% 15/10/2028	101.399	0,09
					EUR	100.000	iliad SA 5.38% 14/06/2027	107.983	0,10
					EUR	100.000	iliad SA 5.63% 15/02/2030	105.615	0,10

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
FRANKREICH (Fortsetzung)				DEUTSCHLAND (Fortsetzung)			
EUR	182.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	192.741	0,18	EUR	129.000	Techem
EUR	160.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	172.189	0,16			Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 2.00% 15/07/2025
EUR	163.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	178.666	0,16	EUR	100.000	Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029
EUR	100.000	Renault SA 2.38% 25/05/2026	99.613	0,09	EUR	100.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032
EUR	100.000	Renault SA 2.50% 02/06/2027	95.970	0,09	EUR	19.000	Volkswagen Financial Services AG 3.38% 06/04/2028
EUR	100.000	Rexel SA 2.13% 15/06/2028	95.855	0,09	EUR	100.000	Vonovia SE 5.00% 23/11/2030
EUR	100.000	Tereos Finance Groupe I SA 7.25% 15/04/2028	106.820	0,10	EUR	100.000	ZF Finance GmbH 3.75% 21/09/2028
EUR	100.000	Valeo 5.38% 28/05/2027	108.323	0,10			97.252
EUR	200.000	Verallia SA 1.63% 14/05/2028	190.690	0,17			Deutschland, insgesamt
EUR	100.000	Verallia SA 1.88% 10/11/2031	88.225	0,08			2.916.572
		Frankreich, insgesamt	4.740.463	4,37			2,67
DEUTSCHLAND				GIBRALTAR			
EUR	100.000	Amprion GmbH 3.97% 22/09/2032	110.752	0,10	EUR	130.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027
EUR	200.000	Bayer AG FRN 25/03/2082	202.018	0,19			120.240
EUR	130.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	130.715	0,13			Gibraltar, insgesamt
EUR	101.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	102.447	0,09			120.240
EUR	100.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	89.486	0,08			0,11
EUR	46.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	46.902	0,04			GRIECHENLAND
USD	150.000	Deutsche Bank AG FRN 28/05/2032	116.030	0,11	EUR	119.000	Eurobank SA FRN 26/01/2029
EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	209.659	0,19			126.036
EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	196.444	0,18			Griechenland, insgesamt
EUR	111.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	109.960	0,10			126.036
EUR	100.000	Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	99.063	0,09			0,12
EUR	110.000	HT Troplast GmbH 9.25% 15/07/2025	118.621	0,11			IRLAND
EUR	155.000	IHO Verwaltungs GmbH 8.75% 15/05/2028	172.689	0,16	EUR	100.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029
EUR	200.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	166.534	0,15	EUR	276.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026
EUR	115.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	109.055	0,10	GBP	185.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 4.88% 15/07/2028
EUR	126.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	118.964	0,10			195.420
EUR	191.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	169.011	0,16			Irland, insgesamt
EUR	100.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	99.727	0,09			581.764
							0,54
							ITALIEN
					EUR	206.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.63% 25/01/2028
					EUR	100.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028
					EUR	100.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 15/01/2030
					EUR	170.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026
					EUR	149.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027
					EUR	100.000	Intesa Sanpaolo SpA FRN 12/07/2029
					EUR	100.000	Lottomatica SpA 6.25% 15/07/2025
							107.228
							108.579
							0,10
							0,10

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
ITALIEN (Fortsetzung)				LUXEMBURG (Fortsetzung)					
EUR	100.000	Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	115.473	0,11	EUR	27.029	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	29.362	0,03
EUR	113.000	Mundys SpA 1.88% 13/07/2027	108.947	0,10	EUR	100.000	Eurofins Scientific SE FRN 13/11/2166	100.380	0,09
EUR	193.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	190.855	0,17	GBP	100.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.75% 01/11/2025	94.184	0,09
EUR	220.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	228.598	0,21	EUR	100.000	Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	76.816	0,07
EUR	150.000	Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	156.508	0,14	EUR	384.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	355.919	0,33
EUR	119.000	Telecom Italia SpA 6.88% 15/02/2028	132.289	0,12	EUR	98.240	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	106.228	0,10
		Italien, insgesamt	1.831.692	1,66	EUR	140.000	Loarre Investments Sarl 6.50% 15/05/2029	141.972	0,13
JAPAN				MEXIKO					
USD	200.000	Central Nippon Expressway Company Limited 0.89% 10/12/2025	180.128	0,16	EUR	100.000	Matterhorn Telecom SA 4.00% 15/11/2027	100.578	0,09
EUR	100.000	Softbank Group Corp. 3.13% 19/09/2025	99.616	0,09	EUR	100.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	81.710	0,07
		Japan, insgesamt	279.744	0,25	EUR	100.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	101.063	0,09
JERSEY - KANALINSELN				LUXEMBURG					
EUR	159.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	168.809	0,15	EUR	200.000	Agps Bondco plc 3.25% 05/08/2025	88.383	0,08
EUR	100.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	87.896	0,08	EUR	130.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	133.238	0,12
GBP	50.000	Heathrow Funding Limited 6.45% 10/12/2031	65.883	0,06	EUR	137.000	Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	112.307	0,10
EUR	100.000	Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	100.678	0,09	EUR	164.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	133.766	0,12
		Jersey - Kanalinseln, insgesamt	423.266	0,38	GBP	120.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	93.795	0,09
LUXEMBURG				NIEDERLANDE					
EUR	200.000	Agps Bondco plc 3.25% 05/08/2025	88.383	0,08	EUR	137.000	Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	128.453	0,12
EUR	130.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	133.238	0,12	EUR	100.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/01/2025	107.550	0,10
EUR	137.000	Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	112.307	0,10	EUR	200.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	212.227	0,19
EUR	164.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	133.766	0,12	EUR	200.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	211.457	0,19
GBP	120.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	93.795	0,09	EUR	100.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	76.581	0,07
GBP	140.000	B&M European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	163.010	0,15	EUR	146.000	Dufry One BV 2.00% 15/02/2027	137.372	0,13
EUR	141.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	125.252	0,11	GBP	68.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	88.672	0,08
EUR	121.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	127.421	0,12					
		Luxemburg, insgesamt	2.416.088	2,21					
		Mexiko, insgesamt	214.918	0,20					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
NIEDERLANDE (Fortsetzung)				NIEDERLANDE (Fortsetzung)					
USD	15.000	E.ON International Finance BV 6.65% 30/04/2038	16.432	0,02	EUR	100.000	ZF Europe Finance BV 3.00% 23/10/2029	91.849	0,08
EUR	100.000	Naturgy Finance BV - Perp FRN	94.761	0,09	Niederlande, insgesamt			3.708.835	3,35
EUR	100.000	OI European Group BV 2.88% 15/02/2025	105.917	0,10	NORWEGEN				
EUR	167.000	PPF Telecom Group BV 3.25% 29/09/2027	166.900	0,15	EUR	100.000	DNB Bank ASA FRN 21/09/2027	106.886	0,10
EUR	100.000	Repsol International Finance BV FRN 22/03/2170	94.780	0,09	USD	244.000	Kommunalbanken AS 0.38% 11/09/2025	222.977	0,20
EUR	100.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	91.474	0,08	Norwegen, insgesamt			329.863	0,30
EUR	100.000	Stellantis NV 1.25% 20/06/2033	81.619	0,07	PORTUGAL				
EUR	144.765	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	123.407	0,11	EUR	100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 14/03/2082	91.432	0,08
EUR	129.877	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	110.716	0,10	EUR	100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 23/04/2083	106.756	0,10
EUR	100.000	Telefonica Europe BV FRN 24/05/2170	90.537	0,08	Portugal, insgesamt			198.188	0,18
EUR	100.000	Telefonica Europe BV FRN 23/11/2171	110.843	0,10	RUMÄNIEN				
EUR	100.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	90.537	0,08	EUR	100.000	RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	102.757	0,09
EUR	200.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	212.585	0,19	Rumänien, insgesamt			102.757	0,09
EUR	287.000	Tennet Holding BV FRN 22/10/2168	291.296	0,26	SPANIEN				
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.75% 09/05/2027	98.520	0,09	EUR	200.000	Banco de SAbadell SA FRN 07/02/2029	206.192	0,20
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.38% 09/05/2030	92.239	0,08	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.00% 15/09/2027	92.918	0,08
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 7.38% 15/09/2029	110.316	0,10	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.25% 15/01/2029	88.931	0,08
EUR	100.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	81.600	0,07	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.50% 08/06/2028	92.733	0,08
EUR	100.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	89.869	0,08	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 2.00% 15/02/2033	83.416	0,08
EUR	100.000	Villa Dutch Bidco BV 9.00% 03/11/2029	103.004	0,09	EUR	200.000	Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	204.447	0,20
EUR	100.000	Volkswagen International Finance NV 3.25% 18/11/2030	101.765	0,09	EUR	100.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	90.566	0,08
EUR	100.000	VZ Vendor Financing II BV 2.88% 15/01/2029	87.071	0,08	EUR	144.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	122.450	0,11
EUR	100.000	Wolters Kluwer NV 3.75% 03/04/2031	109.296	0,10	EUR	100.000	Grifols SA 1.63% 15/02/2025	102.536	0,09
EUR	100.000	ZF Europe Finance BV 2.00% 23/02/2026	99.190	0,09	EUR	100.000	Grifols SA 2.25% 15/11/2027	92.510	0,08
					EUR	100.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	99.131	0,09
					EUR	100.000	Kaixo Bondco Telecom SA 5.13% 30/09/2029	95.652	0,09

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
SPANIEN (Fortsetzung)				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					
EUR	272.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	272.088	0,26	GBP	100.000	Co-Operative Bank Finance plc FRN 06/04/2027	116.070	0,11
		Spanien, insgesamt	1.643.570	1,52	GBP	137.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	141.475	0,13
SCHWEDEN				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					
EUR	162.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2169	90.565	0,08	EUR	155.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	151.461	0,14
EUR	50.000	Heimstaden Bostad AB FRN 01/05/2170	27.952	0,03	EUR	109.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	109.458	0,10
EUR	52.111	Intrum AB 3.13% 15/07/2024	54.497	0,05	EUR	19.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	20.123	0,02
EUR	135.000	Intrum AB 3.50% 15/07/2026	122.410	0,11	GBP	100.000	HSBC Holdings plc FRN 16/11/2034	130.040	0,12
EUR	100.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	100.679	0,09	EUR	100.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	101.935	0,09
EUR	100.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	88.314	0,08	EUR	100.000	INEOS Finance plc 6.63% 15/05/2028	109.722	0,10
EUR	100.000	Sagax AB 2.25% 13/03/2025	102.343	0,09	EUR	100.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	97.788	0,09
EUR	110.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB - Perp FRN	44.302	0,04	EUR	119.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	116.368	0,11
EUR	100.000	Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	101.103	0,09	EUR	190.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	199.716	0,18
EUR	100.000	Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	108.979	0,10	GBP	187.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	219.655	0,20
EUR	155.000	Verisure Midholding A 5.25% 15/02/2029	140.316	0,13	EUR	136.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	145.445	0,13
		Schweden, insgesamt	981.460	0,89	EUR	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	104.047	0,10
SCHWEIZ				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					
EUR	100.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	85.732	0,08	GBP	200.000	Jerrold Finco plc 5.25% 15/01/2027	208.651	0,18
EUR	100.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	71.338	0,07	GBP	200.000	Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 08/09/2023	246.092	0,21
		Schweiz, insgesamt	157.070	0,15	GBP	201.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	225.118	0,20
VEREINIGTES KÖNIGREICH				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					
GBP	100.000	Barclays plc 3.25% 12/02/2027	112.541	0,10	EUR	100.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	83.304	0,08
EUR	103.000	BCP V Modular Services Finance II plc 4.75% 30/11/2028	95.358	0,09	GBP	100.000	National Grid Electricity Transmission plc 1.13% 07/07/2028	101.820	0,09
GBP	167.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	134.929	0,12	EUR	100.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	87.951	0,08
USD	94.000	BP Capital Markets plc FRN 22/09/2168	90.163	0,08	EUR	200.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	201.527	0,18
EUR	142.000	BP Capital Markets plc - Perp FRN	143.039	0,12	GBP	100.000	Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	112.335	0,10
EUR	100.000	British American Tobacco plc FRN 27/12/2169	88.685	0,08	GBP	100.000	Rolls-Royce plc 3.38% 18/06/2026	112.573	0,10
GBP	75.000	Broadgate Financing plc 5.00% 05/10/2031	90.043	0,08	GBP	121.000	Rolls-Royce plc 5.75% 15/10/2027	143.213	0,13
EUR	100.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	87.651	0,08	GBP	15.000	Santander UK plc Perp 10.06%	26.901	0,02

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					
EUR	171.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	160.243	0,15	EUR	219.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	197.037	0,19
EUR	100.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	99.990	0,09	USD	114.000	Astrazeneca Finance LLC 4.88% 03/03/2028	117.366	0,11
GBP	100.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	110.722	0,10	USD	119.000	AT&T Inc. 3.50% 15/09/2053	86.539	0,08
EUR	100.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	93.938	0,09	USD	44.000	AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	42.257	0,04
EUR	100.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	88.113	0,08	EUR	158.000	Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	165.625	0,15
GBP	311.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	335.987	0,32	USD	30.000	Bank of America Corp. FRN 21/07/2032	24.221	0,02
EUR	100.000	Virgin Money UK plc FRN 29/10/2028	103.642	0,09	USD	53.000	Bank of America Corp. FRN 13/02/2031	44.925	0,04
EUR	100.000	Vodafone Group plc FRN 03/01/2079	107.189	0,10	USD	91.000	Bank of America Corp. FRN 29/04/2031	77.001	0,07
GBP	155.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	182.699	0,17	USD	66.000	Bank of America Corp. FRN 11/03/2032	55.141	0,05
USD	231.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	226.144	0,21	USD	30.000	Bank of America Corp. FRN 04/02/2033	25.424	0,02
GBP	100.000	Wessex Water Services Finance plc 5.13% 31/10/2032	122.116	0,11	USD	42.000	Bank of America Corp. FRN 23/07/2030	37.445	0,03
GBP	164.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	153.414	0,14	USD	91.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 3.85% 15/03/2052	76.680	0,07
		Vereinigtes Königreich, insgesamt	5.939.394	5,39	USD	25.000	Boeing Company 3.95% 01/08/2059	18.492	0,02
					USD	30.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	30.003	0,03
VEREINIGTE STAATEN					USD	12.000	Broadcom Inc. 4.15% 15/11/2030	11.141	0,01
USD	63.000	AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	55.679	0,05	USD	25.000	Brown-Forman Corp. 4.75% 15/04/2033	25.242	0,02
USD	10.000	AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	9.659	0,01	EUR	100.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	98.008	0,09
USD	22.000	AEP Texas Inc. 3.45% 15/05/2051	16.096	0,01	USD	18.000	Charter Communications Operating LLC 3.90% 01/06/2052	11.915	0,01
USD	161.000	Amazon.com Inc. 4.70% 01/12/2032	165.357	0,14	USD	40.000	Charter Communications Operating LLC 3.95% 30/06/2062	25.435	0,02
USD	21.000	American Transmission Systems Inc. 2.65% 15/01/2032	17.752	0,02	USD	17.000	Commonwealth Edison Company 4.00% 01/03/2049	14.271	0,01
USD	23.000	Amgen Inc. 2.20% 21/02/2027	21.191	0,02	USD	13.000	Commonwealth Edison Company 5.30% 01/02/2053	13.629	0,01
USD	32.000	Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	29.433	0,03	USD	12.000	Connecticut Light and Power Company 5.25% 15/01/2053	12.427	0,01
USD	35.000	Amgen Inc. 3.15% 21/02/2040	27.530	0,03	USD	15.000	Consolidated Edison Company of New York Inc. 3.95% 01/04/2050	12.477	0,01
USD	12.000	Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	10.195	0,01	USD	21.000	CSX Corp. 3.80% 15/04/2050	17.139	0,02
USD	10.000	Amgen Inc. 4.88% 01/03/2053	9.386	0,01	USD	16.000	CSX Corp. 4.50% 15/11/2052	14.671	0,01
USD	33.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	33.759	0,03	USD	150.000	Daimler Truck Finance North America LLC 5.13% 19/01/2028	150.340	0,14
USD	122.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	125.409	0,11					
USD	19.000	Amgen Inc. 5.65% 02/03/2053	19.782	0,02					
USD	56.000	Amgen Inc. 5.75% 02/03/2063	58.306	0,05					
USD	113.000	Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	112.602	0,10					
USD	50.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 4.35% 01/06/2040	47.032	0,04					
USD	40.000	Apple Inc. 2.65% 11/05/2050	28.398	0,03					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					
USD	30.000	Emera US Finance LP 4.75% 15/06/2046	24.502	0,02	USD	199.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	167.343	0,16
USD	53.000	Enterprise Products Operating LLC 4.45% 15/02/2043	47.377	0,04	USD	33.000	JPMorgan Chase & Company FRN 25/01/2033	28.288	0,03
USD	169.000	Eversource Energy 2.55% 15/03/2031	144.327	0,13	USD	45.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2041	34.429	0,03
USD	31.000	Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	23.611	0,02	USD	78.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	68.726	0,06
USD	25.000	Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	19.041	0,02	USD	17.000	Kinder Morgan Inc. 5.20% 01/06/2033	16.882	0,02
USD	23.000	Eversource Energy 5.45% 01/03/2028	23.842	0,02	GBP	100.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	119.570	0,11
USD	20.000	Federal Home Loan Banks 5.50% 15/07/2036	22.990	0,02	USD	12.000	Lowe's Companies Inc. 5.75% 01/07/2053	12.238	0,01
EUR	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	101.370	0,09	USD	47.000	Lowe's Companies Inc. 5.80% 15/09/2062	47.503	0,04
GBP	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	117.866	0,11	USD	35.000	Metropolitan Edison Company 4.30% 15/01/2029	33.637	0,03
EUR	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	106.940	0,10	USD	156.000	Metropolitan Life Global Funding I 1.55% 07/01/2031	124.980	0,11
GBP	200.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	237.748	0,22	USD	25.000	Microsoft Corp. 4.10% 06/02/2037	24.938	0,02
EUR	139.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.87% 03/08/2027	146.584	0,13	EUR	100.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	104.880	0,10
GBP	108.000	Ford Motor Credit Company LLC 6.86% 05/06/2026	133.405	0,12	USD	37.000	New York Life Global Funding 4.55% 28/01/2033	36.647	0,03
USD	19.000	Georgia Power Company 3.70% 30/01/2050	14.779	0,01	USD	33.000	New York Life Global Funding 4.85% 09/01/2028	33.517	0,03
USD	15.000	Georgia Power Company 5.13% 15/05/2052	14.710	0,01	USD	17.000	New York Life Insurance Company 4.45% 04/04/2069	15.083	0,01
USD	19.000	Goodman USA Finance Five LLC 4.63% 04/05/2032	17.835	0,02	USD	25.000	NiSource Inc. 4.38% 15/05/2047	21.729	0,02
USD	26.000	Goodman USA Finance Three LLC 3.70% 15/03/2028	24.028	0,02	USD	125.000	NiSource Inc. 4.80% 15/02/2044	115.349	0,11
USD	25.000	Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	22.130	0,02	USD	14.000	NiSource Inc. 5.00% 15/06/2052	13.347	0,01
USD	20.000	HCA Inc. 5.88% 01/02/2029	20.444	0,02	USD	86.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.45% 30/03/2051	63.402	0,06
USD	14.000	Indiana Michigan Power Company 5.63% 01/04/2053	14.572	0,01	USD	8.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 3.63% 30/09/2059	5.961	0,01
USD	36.000	Intel Corp. 4.75% 25/03/2050	33.057	0,03	USD	28.000	Occidental Petroleum Corp. 6.38% 01/09/2028	29.143	0,03
USD	24.000	Intel Corp. 5.13% 10/02/2030	24.437	0,02	USD	56.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	59.183	0,05
EUR	200.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/01/2028	193.307	0,18	USD	30.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	32.944	0,03
EUR	116.000	IQVIA Inc. 2.25% 15/03/2029	107.667	0,10	USD	65.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	75.684	0,07
EUR	100.000	IQVIA Inc. 2.88% 15/06/2028	97.862	0,09	USD	44.000	Oracle Corp. 2.88% 25/03/2031	37.760	0,04
USD	47.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	39.380	0,04	USD	29.000	Oracle Corp. 3.60% 01/04/2040	22.514	0,02
USD	40.000	JPMorgan Chase & Company FRN 04/02/2032	32.180	0,03	USD	29.000	Oracle Corp. 3.65% 25/03/2041	22.462	0,02

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
USD	97.000 Pacific Gas and Electric Company 4.95% 01/07/2050	80.119	0,07	USD	82.000 UnitedHealth Group Inc. 4.50% 15/04/2033	81.578	0,07
USD	20.000 Piedmont Natural Gas Company Inc. 3.35% 01/06/2050	14.116	0,01	USD	34.000 UnitedHealth Group Inc. 4.95% 15/05/2062	33.125	0,03
USD	39.000 Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	34.691	0,03	USD	60.000 UnitedHealth Group Inc. 5.30% 15/02/2030	63.319	0,06
USD	39.000 Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	30.695	0,03	USD	20.000 UnitedHealth Group Inc. 6.05% 15/02/2063	22.785	0,02
USD	33.000 PPL Electric Utilities Corp 4.15% 15/06/2048	29.511	0,03	USD	101.000 Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	96.091	0,09
USD	30.000 PPL Electric Utilities Corp. 5.00% 15/05/2033	30.647	0,03	USD	119.000 Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	96.623	0,09
USD	56.000 Public Service Electric and Gas Company 4.65% 15/03/2033	56.306	0,05	USD	50.000 Warnermedia Holdings Inc. 5.39% 15/03/2062	40.489	0,04
USD	28.000 RELX Capital Inc. 4.75% 20/05/2032	27.837	0,03	USD	50.000 Williams Partners LP 4.85% 01/03/2048	44.421	0,04
USD	16.000 Republic Services Inc. 4.88% 01/04/2029	16.193	0,01		Vereinigte Staaten, insgesamt	6.717.202	6,10
USD	30.000 San Diego Gas & Electric Company 3.32% 15/04/2050	22.199	0,02		Anleihen, insgesamt	35.016.964	31,94
USD	17.000 San Diego Gas & Electric Company 4.15% 15/05/2048	14.842	0,01	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente			
EUR	100.000 Silgan Holdings Inc. 2.25% 01/06/2028	91.939	0,08	AUSTRALIEN			
EUR	129.000 Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	136.884	0,12	AUD	32.000 Australia (Govt of) 1.00% 21/12/2030	18.194	0,02
USD	22.000 Southern California Edison Company 4.13% 01/03/2048	18.283	0,02		Australien, insgesamt	18.194	0,02
USD	13.000 Southern California Gas Company 3.95% 15/02/2050	10.515	0,01	ÖSTERREICH			
USD	11.000 Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.90% 15/09/2044	10.194	0,01	EUR	5.000 Austria (Govt of) 0.85% 30/06/2120	2.356	0,00
GBP	50.000 Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	59.688	0,05	EUR	187.000 Austria (Govt of) 2.90% 20/02/2033	202.111	0,18
USD	23.000 T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	20.286	0,02		Österreich, insgesamt	204.467	0,18
USD	42.000 T-Mobile USA Inc. 2.88% 15/02/2031	36.258	0,03	BELGIEN			
USD	20.000 T-Mobile USA Inc. 3.40% 15/10/2052	14.426	0,01	EUR	18.000 Belgium (Govt of) 0.90% 22/06/2029	17.603	0,02
USD	26.000 T-Mobile USA Inc. 4.95% 15/03/2028	26.251	0,02		Belgien, insgesamt	17.603	0,02
USD	26.000 T-Mobile USA Inc. 5.05% 15/07/2033	26.141	0,02	KANADA			
USD	17.000 T-Mobile USA Inc. 5.80% 15/09/2062	17.625	0,02	CAD	52.000 Canada (Govt of) 2.75% 01/12/2048	36.254	0,03
USD	46.000 Toyota Motor Credit Corp. 4.63% 12/01/2028	46.578	0,04	CAD	240.000 Canada Housing Trust No 1 1.10% 15/03/2031	150.518	0,14

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					
KANADA (Fortsetzung)				MEXIKO					
USD	80.000	Province of Ontario Canada 1.13% 07/10/2030	65.423	0,06	USD	1.268.000	Mexico (Govt of) 5.75% 12/10/2110	1.140.820	1,04
		Kanada, insgesamt	252.195	0,23			Mexiko, insgesamt	1.140.820	1,04
FRANKREICH				SPANIEN					
EUR	100.000	Bpifrance SACA 2.88% 25/11/2029	107.378	0,10	EUR	45.000	Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2027	43.213	0,04
EUR	100.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/02/2028	94.084	0,09	EUR	9.000	Spain (Govt of) 0.10% 30/04/2031	7.696	0,01
USD	200.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 1.00% 21/10/2030	164.458	0,15	EUR	18.000	Spain (Govt of) 2.90% 31/10/2046	17.128	0,02
USD	200.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 1.38% 20/01/2031	166.858	0,14			Spanien, insgesamt	68.037	0,07
EUR	100.000	Unedic Asseo 0.25% 16/07/2035	76.292	0,07			SUPRANATIONAL		
		Frankreich, insgesamt	609.070	0,55	USD	80.000	Asian Development Bank 0.75% 08/10/2030	64.687	0,06
DEUTSCHLAND				VEREINIGTES KÖNIGREICH					
EUR	482.000	Germany (Govt of) 0.00% 09/10/2026	481.341	0,44	GBP	300.000	United Kingdom Gilt 0.63% 31/07/2035	260.478	0,24
EUR	179.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/02/2032	159.658	0,15	GBP	161.000	United Kingdom Gilt 0.88% 31/07/2033	153.469	0,14
EUR	24.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2052	13.426	0,01					
		Deutschland, insgesamt	654.425	0,60					
ITALIEN				VEREINIGTES KÖNIGREICH					
USD	200.000	Italy (Govt of) 1.25% 17/02/2026	179.083	0,16					
EUR	12.000	Italy (Govt of) 2.45% 01/09/2033	11.246	0,01					
EUR	3.000	Italy (Govt of) 4.00% 30/04/2035	3.188	0,00					
		Italien, insgesamt	193.517	0,17					
JAPAN				VEREINIGTES KÖNIGREICH					
JPY	13.950.000	Japan (Govt of) Forty Year Bond 0.40% 20/03/2056	79.649	0,07					
JPY	4.150.000	Japan (Govt of) Forty Year Bond 0.50% 20/03/2059	23.954	0,02					
JPY	800.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.40% 20/06/2049	4.891	0,00					
JPY	1.300.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.60% 20/09/2050	8.267	0,01					
JPY	2.200.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.70% 20/12/2051	14.277	0,01					
		Japan, insgesamt	131.038	0,11					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)			
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
GBP	3.000 United Kingdom Gilt 1.13% 31/01/2039	2.527	0,00	USD	2.600.000 United States Treasury N/B 3.88% 15/02/2043	2.625.594	2,41
GBP	40.000 United Kingdom Gilt 1.25% 22/10/2041	32.662	0,03	USD	16.000 United States Treasury N/B 4.00% 31/10/2029	16.388	0,01
GBP	770.000 United Kingdom Gilt 1.25% 31/07/2051	533.424	0,49	Vereinigte Staaten, insgesamt			
GBP	4.000 United Kingdom Gilt 1.75% 07/09/2037	3.847	0,00	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt			
GBP	55.000 United Kingdom Gilt 4.13% 29/01/2027	68.943	0,06	16.505.742 15,08			
GBP	1.700.000 United Kingdom Inflation- Linked Gilt 0.15% 22/03/2051	2.386.798	2,18	Aktien			
Vereinigtes Königreich, insgesamt				AUSTRALIEN			
3.442.148 3,14				14.482	ANZ Group Holdings Limited	222.405	0,20
VEREINIGTE STAATEN				9.474	Coles Group Limited	114.341	0,10
USD	421.000 United States Treasury N/B 0.13% 15/07/2023	415.672	0,38	59.546	Deterra Royalties Limited	191.428	0,17
USD	60.000 United States Treasury N/B 0.13% 31/07/2023	59.123	0,05	19.638	Dexus	98.776	0,09
USD	40.000 United States Treasury N/B 0.50% 31/10/2027	34.719	0,03	1.662	Macquarie Group Limited	195.531	0,18
USD	618.000 United States Treasury N/B 0.63% 15/08/2030	503.718	0,46	3.430	Mineral Resources Limited	185.135	0,17
USD	19.000 United States Treasury N/B 0.75% 31/01/2028	16.604	0,02	37.205	Santos Limited	171.935	0,16
USD	145.000 United States Treasury N/B 1.00% 31/07/2028	126.750	0,12	11.870	Telstra Corp. Limited	33.549	0,03
USD	540.100 United States Treasury N/B 1.13% 15/08/2040	357.605	0,33	26.697	Transurban Group	254.079	0,23
USD	17.000 United States Treasury N/B 1.25% 15/05/2050	9.893	0,01	Australien, insgesamt			
USD	95.000 United States Treasury N/B 1.38% 15/11/2040	65.535	0,06	1.467.179 1,33			
USD	17.000 United States Treasury N/B 1.88% 15/02/2032	14.925	0,01	BELGIEN			
USD	47.600 United States Treasury N/B 1.88% 15/02/2051	32.528	0,03	1.740	KBC Group NV	119.664	0,11
USD	3.000 United States Treasury N/B 1.88% 15/11/2051	2.044	0,00	565	Melexis NV	65.313	0,06
USD	24.000 United States Treasury N/B 2.38% 31/03/2029	22.416	0,02	Belgien, insgesamt			
USD	1.913.200 United States Treasury N/B 3.00% 15/08/2052	1.680.477	1,53	184.977 0,17			
USD	43.000 United States Treasury N/B 3.25% 30/06/2029	42.170	0,04	KANADA			
USD	3.245.000 United States Treasury N/B 3.38% 15/08/2042	3.050.552	2,80	403	Canadian National Railway Company	47.487	0,04
				1.729	Suncor Energy Inc.	53.607	0,05
				Kanada, insgesamt			
				101.094 0,09			
				KAIMANINSELN			
				36.000	China Mengniu Dairy Company Limited	147.670	0,14
				48.000	China Resources Land Limited	218.905	0,20
				5.050	JD.com Inc.	110.650	0,10
				416	NetEase Inc. - ADR	36.791	0,03
				9.755	NetEase Inc.	171.490	0,16
				5.000	Parade Technologies Limited	172.426	0,16
				Kaimaninseln, insgesamt			
				857.932 0,79			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
CHINA				DEUTSCHLAND (Fortsetzung)			
126.800	Baoshan Iron & Steel Company Limited - A	115.218	0,11	1.550	Siemens Healthineers AG	89.286	0,08
395.000	China Construction Bank Corp.	256.122	0,23	Deutschland, insgesamt			
20.000	China Merchants Bank Company Limited - H	102.166	0,09	1.023.009 0,93			
28.500	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	120.851	0,12	GUERNSEY - KANALINSELN			
39.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	253.874	0,23	28.524	Sherborne Investors Guernsey C Limited	18.516	0,02
5.400	Wuliangye Yibin Company Limited - A	154.908	0,14	Guernsey - Kanalinseln, insgesamt			
China, insgesamt				18.516 0,02			
1.003.139 0,92				HONGKONG			
DÄNEMARK				36.600	AIA Group Limited	385.350	0,35
4.519	Tryg A/S	98.796	0,09	56.000	BOC Hong Kong Holdings Limited	174.421	0,16
Dänemark, insgesamt				29.000	Galaxy Entertainment Group Limited	193.765	0,18
98.796 0,09				136.000	Guangdong Investment Limited	139.119	0,12
FINNLAND				5.100	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	226.220	0,21
666	Upm-Kymmene Oyj	22.395	0,02	68.000	Lenovo Group Limited	73.631	0,07
Finnland, insgesamt				14.000	Sun Hung Kai Properties Limited	196.179	0,18
22.395 0,02				62.000	Xinyi Glass Holdings Limited	111.048	0,10
FRANKREICH				Hongkong, insgesamt			
790	Air Liquide SA	132.349	0,12	1.499.733 1,37			
7.059	AXA SA	216.004	0,20	INDIEN			
2.863	BNP Paribas SA	171.731	0,16	43.751	Embassy Office Parks REIT	166.188	0,15
1.494	Compagnie de Saint-Gobain	84.924	0,08	9.856	HDFC Bank Limited	193.030	0,18
184	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	168.801	0,15	18.774	Hindalco Industries Limited	92.599	0,08
578	Pernod-Ricard SA	131.057	0,12	15.206	Infosys Limited	264.209	0,24
1.045	Sanofi	113.807	0,10	58.688	Power Grid Corp. of India Limited	161.176	0,15
1.070	Schneider Electric SE	178.653	0,17	Indien, insgesamt			
3.719	TotalEnergies SE	219.642	0,20	877.202 0,80			
1.350	Vinci SA	155.060	0,14	INDONESIEN			
Frankreich, insgesamt				247.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	154.017	0,14
1.572.028 1,44				669.221	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	211.102	0,19
DEUTSCHLAND				Indonesien, insgesamt			
1.679	Brenntag SE	126.231	0,12	365.119 0,33			
2.236	Daimler Truck Holding AG	75.576	0,07	IRLAND			
6.530	Deutsche Telekom AG - Reg	158.562	0,14	10.032	Bank of Ireland Group plc	101.625	0,09
3.779	E.ON SE	47.215	0,04	3.601	CRH plc	181.824	0,16
1.575	Evonik Industries AG	33.128	0,03	5.356	Eaton Corp. plc	917.697	0,83
902	Mercedes-Benz Group AG - Reg	69.363	0,06				
1.450	SAP SE	182.835	0,17				
1.485	Siemens AG - Reg	240.813	0,22				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
IRLAND (Fortsetzung)				PHILIPPINEN			
1.985	Experian plc	65.286	0,06	74.150	BDO Unibank Inc.	175.263	0,16
4.926	Johnson Controls International plc	296.644	0,27		Philippinen, insgesamt	175.263	0,16
149	Linde plc	52.961	0,05				
7.743	Medtronic plc	624.241	0,56				
3.031	Trinseo plc	63.196	0,06				
	Irland, insgesamt	2.303.474	2,08				
ITALIEN				SÜDKOREA			
28.347	Enel SpA	173.298	0,16	3.048	Kia Corp.	189.644	0,18
14.133	Nexi SpA	114.946	0,10	701	LG Chem Limited	167.194	0,14
	Italien, insgesamt	288.244	0,26	1.634	Samsung Electronics Company Limited	80.329	0,07
				9.971	Samsung Electronics Company Limited Pfd	412.827	0,38
				4.517	SK Telecom Company Limited	167.586	0,15
					Südkorea, insgesamt	1.017.580	0,92
JAPAN				SINGAPUR			
400	Rohm Company Limited	32.970	0,03	136.800	CapitaLand Integrated Commercial Trust	203.726	0,19
100	SMC Corp.	52.468	0,05	2.600	Jardine Cycle & Carriage Limited	61.170	0,06
300	Tokyo Electron Limited	36.156	0,03	26.800	Keppel Corp. Limited	113.485	0,10
15.200	Z Holdings Corp.	42.577	0,04	8.000	United Overseas Bank Limited	179.068	0,16
	Japan, insgesamt	164.171	0,15		Singapur, insgesamt	557.449	0,51
JERSEY - KANALINSELN				SPANIEN			
12.533	WPP plc	148.549	0,14	9.245	Iberdrola SA	115.358	0,11
	Jersey - Kanalinseln, insgesamt	148.549	0,14	5.765	Inditex SA	193.539	0,18
MALAYSIA				Spanien, insgesamt			
99.100	CIMB Group Holdings Bhd	119.257	0,11		308.897	0,29	
	Malaysia, insgesamt	119.257	0,11				
NIEDERLANDE				SCHWEDEN			
533	Akzo Nobel NV	41.682	0,04	6.226	Sandvik AB	131.970	0,12
366	ASM International NV	147.883	0,14		Schweden, insgesamt	131.970	0,12
1.754	BE Semiconductor Industries NV	152.641	0,14				
26.723	Royal KPN NV	94.532	0,09				
	Niederlande, insgesamt	436.738	0,41				
NORWEGEN				SCHWEIZ			
1.368	Equinor ASA	39.016	0,04	946	Nestle SA - Reg	115.419	0,11
	Norwegen, insgesamt	39.016	0,04	621	Novartis AG - Reg	56.937	0,05
				92	Partners Group Holding AG - Reg	86.285	0,08
				391	Roche Holding AG	111.687	0,10
				3.484	TE Connectivity Limited	456.926	0,42
					Schweiz, insgesamt	827.254	0,76
				TAIWAN			
				21.850	Chailease Holding Company Limited	160.388	0,15
				23.000	Chroma ATE Inc.	134.082	0,12

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
TAIWAN (Fortsetzung)				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)			
17.000	Delta Electronics Inc.	168.058	0,15	2.545	Oxford Instruments plc	78.826	0,07
1.000	MediaTek Inc.	25.847	0,02	8.978	Pearson plc	93.736	0,09
46.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	805.245	0,74	1.540	Pennon Group plc	16.642	0,02
22.000	Unimicron Technology Corp.	106.576	0,10	2.571	Persimmon plc	39.927	0,04
10.000	Yageo Corp.	173.739	0,16	11.151	Phoenix Group Holdings plc	75.336	0,07
	Taiwan, insgesamt	1.573.935	1,44	1.886	Reckitt Benckiser Group plc	143.601	0,13
				1.116	RELX plc	36.120	0,03
				2.534	RELX plc	82.026	0,07
				18.203	Rentokil Initial plc	133.152	0,12
				13.421	RS Group plc	151.673	0,14
				3.621	Smith & Nephew plc	50.234	0,05
				2.942	Smiths Group plc	62.440	0,06
				6.407	SSE plc	142.832	0,13
				9.072	St James's Place plc	135.839	0,12
				6.080	Tate & Lyle plc	58.983	0,05
				17.392	Tesco plc	57.137	0,05
				3.302	Travis Perkins plc	39.048	0,04
				1.496	Unilever plc	77.504	0,07
				70.929	Vodafone Group plc	78.316	0,07
				967	Whitbread plc	35.714	0,03
				8.742	Wincanton plc	23.348	0,02
					Vereinigtes Königreich, insgesamt	3.831.967	3,48
					VEREINIGTE STAATEN		
				418	AbbVie Inc.	66.617	0,06
				5.431	Ameren Corp.	469.184	0,43
				6.313	American Electric Power Company Inc.	574.421	0,52
				174	American Express Company	28.701	0,03
				217	Analog Devices Inc.	42.797	0,04
				2.664	Apple Inc.	439.293	0,40
				11.410	AT&T Inc.	219.643	0,21
				2.363	Automatic Data Processing Inc.	526.075	0,49
				1.173	Becton Dickinson & Company	290.364	0,27
				555	BlackRock Inc.	371.362	0,34
				9.015	Bristol-Myers Squibb Company	624.830	0,57
				1.684	Broadcom Inc.	1.080.353	0,98
				1.319	Caterpillar Inc.	301.840	0,27
				12.402	Cisco Systems Inc.	648.315	0,59
				2.151	CME Group Inc.	411.960	0,37
				789	Coca Cola Company	48.942	0,04
				12.665	Comcast Corp.	480.129	0,43
				2.933	Conocophillips	290.983	0,27
				4.423	DuPont de Nemours Inc.	317.439	0,29
				8.054	Ebay Inc.	357.356	0,33
				4.074	Edison International	287.584	0,26
				124	Elevance Health Inc.	57.016	0,05

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
2.264	Eli Lilly & Company	777.502	0,71	2.678	Warner Bros Discovery Inc.	40.438	0,04
5.077	Equity Lifestyle Properties Inc.	340.819	0,31	6.526	Xcel Energy Inc.	440.113	0,40
8.843	Exxon Mobil Corp.	969.723	0,88				
20.376	Gen Digital Inc.	349.652	0,32		Vereinigte Staaten, insgesamt	28.055.054	25,64
1.615	General Motors Company	59.238	0,05		Aktien, insgesamt	49.250.107	44,97
878	Goldman Sachs Group Inc.	287.203	0,26		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	100.772.813	91,99
2.296	Hess Corp.	303.853	0,28				
703	IntercontinentalExchange Inc.	73.316	0,07		Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere		
2.421	JPMorgan Chase & Company	315.481	0,29				
2.347	KLA Corp.	936.852	0,85		Anleihen		
7.455	Kontoor Brands Inc.	360.748	0,33		VEREINIGTE STAATEN		
2.258	Lamb Weston Holding Inc.	236.006	0,22		USD 23.000	Atlantic City Electric 2.30% 15/03/2031	19.442 0,02
1.518	Lowe's Companies Inc.	303.554	0,28		USD 67.000	Broadcom Inc. 4.93% 15/05/2037	61.045 0,06
243	Marsh & McLennan Companies Inc.	40.472	0,04		USD 119.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	104.343 0,10
867	Mastercard Inc. - A	315.076	0,29		USD 100.000	GE HealthCare Technologies Inc. 5.86% 15/03/2030	104.742 0,10
163	McDonald's Corp.	45.576	0,04		USD 34.000	HCA Inc. 3.63% 15/03/2032	29.992 0,03
7.458	Merck & Company Inc.	793.456	0,73		USD 25.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	28.068 0,03
8.724	Metlife Inc.	505.469	0,46		USD 30.000	Verizon Communications Inc. 2.36% 15/03/2032	24.661 0,02
7.303	Microsoft Corp.	2.105.455	1,92		Vereinigte Staaten, insgesamt	372.293	0,36
5.151	Moelis & Company - A	198.004	0,18		Anleihen, insgesamt	372.293	0,36
6.619	Morgan Stanley	581.149	0,54		Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente		
3.403	Northern Trust Corp.	299.906	0,27		CHINA		
2.907	PepsiCo Inc.	529.947	0,49		CNY 470.000	China (Govt of) 2.85% 04/06/2027	69.147 0,06
8.160	Philip Morris International Inc.	793.560	0,73		CNY 2.550.000	China (Govt of) 3.02% 27/05/2031	375.880 0,34
352	PNC Financial Services Group Inc.	44.739	0,04		China, insgesamt	445.027	0,40
6.260	Procter & Gamble Company	930.800	0,84				
5.319	Prologis Inc.	663.651	0,61				
222	QUALCOMM Inc.	28.323	0,03				
318	Quest Diagnostics Inc.	44.991	0,04				
6.485	Raytheon Technologies Corp.	635.076	0,58				
4.711	Republic Services Inc.	637.021	0,58				
5.257	Starbucks Corp.	547.411	0,50				
825	State Street Corp.	62.444	0,06				
1.950	Target Corp.	322.979	0,29				
3.372	Texas Instruments Inc.	627.226	0,57				
7.029	TJX Companies Inc.	550.792	0,51				
3.216	Union Pacific Corp.	647.252	0,59				
4.129	United Parcel Service Inc.	800.985	0,74				
3.100	Valero Energy Corp.	432.760	0,39				
5.009	Verizon Communications Inc.	194.800	0,18				
18.332	Vici Properties Inc.	597.990	0,55				
3.000	Virtu Financial Inc.	56.700	0,05				
4.077	Voya Financial Inc.	291.342	0,27				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*				
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)				Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente (Fortsetzung)							
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)							
VEREINIGTE STAATEN				VEREINIGTES KÖNIGREICH							
USD	139.000	Federal National Mortgage Association 5.63% 15/07/2037	162.227	0,15	GBP	235.000	Bellis Acquisition Company plc 3.25% 16/02/2026	238.974	0,23		
		Vereinigte Staaten, insgesamt	162.227	0,15	GBP	205.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	237.845	0,22		
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt							Vereinigtes Königreich, insgesamt	476.819	0,45		
Wandelanleihen							VEREINIGTE STAATEN				
KANADA							USD	75.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	63.345	0,06
USD	121.000	Air Canada 4.00% 01/07/2025	143.012	0,13			Vereinigte Staaten, insgesamt	63.345	0,06		
		Kanada, insgesamt	143.012	0,13	Anleihen, insgesamt				721.026	0,67	
Wandelanleihen, insgesamt										721.026	0,67
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt				1.122.559	1,04	Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt				721.026	0,67
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente						Sonstige Organismen für gemeinsame Anlagen					
Anleihen						Fonds					
AUSTRALIEN						VEREINIGTES KÖNIGREICH					
USD	35.000	APA Infrastructure Limited 4.25% 15/07/2027	33.891	0,03	66.280	CT Emerging Market Local Fund***	189.634	0,17			
		Australien, insgesamt	33.891	0,03			Vereinigtes Königreich, insgesamt	189.634	0,17		
BERMUDAS						Fonds, insgesamt				189.634	0,17
USD	100.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	99.392	0,09	Sonstige Organismen für gemeinsame Anlagen, insgesamt				189.634	0,17	
		Bermudas, insgesamt	99.392	0,09	Wert der Anlagen, insgesamt				102.806.032	93,87	
KANADA						(Gesamtkosten: USD 101.827.337)					
CAD	50.000	Rogers Communications Inc. 3.65% 31/03/2027	35.628	0,03	*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.						
		Kanada, insgesamt	35.628	0,03	**Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.						
PORTUGAL						***Fonds der verbundenen Partei.					
EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	11.951	0,01							
		Portugal, insgesamt	11.951	0,01							

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BRASILIEN				GREECE (Fortsetzung)			
22.644	B3 SA Brasil Bolsa Balcao	46.224	0,90	1.314	Jumbo SA	27.838	0,54
16.145	Itau Unibanco Holding SA - ADR	78.626	1,53	Griechenland, insgesamt			
11.218	Localiza Rent a Car SA	118.148	2,30	64.159			
12.019	Sendas Distribuidora SA	36.838	0,72	1,25			
7.406	Weg SA	59.230	1,15	HONGKONG			
Brasilien, insgesamt				2.400			
339.066				6,60			
				700			
				AIA Group Limited			
				25.269			
				0,49			
				Hong Kong Exchanges and Clearing Limited			
				31.050			
				0,60			
				976			
				Techtronic Industries Company			
				10.550			
				0,21			
				Hongkong, insgesamt			
				66.869			
				1,30			
KAIMANINSELN				INDIEN			
535	Afya Limited	5.971	0,12	2.063	Apollo Hospitals Enterprise Limited	108.215	2,11
2.216	JD.com Inc. - ADR	97.260	1,89	2.270	Astral Limited	36.930	0,72
4.286	JD.com Inc.	93.910	1,83	7.749	AU Small Finance Bank Limited	54.613	1,06
10.088	Kingdee International Software Group Company Limited	16.346	0,32	7.594	Cholamandalam Investment and Finance Company Limited	70.347	1,37
10.110	Meituan	184.814	3,60	2.637	HDFC Bank Limited - ADR	175.809	3,42
915	PDD Holdings Inc.	69.449	1,35	7.647	ICICI Bank Limited - ADR	165.022	3,21
2.400	Shenzhou International Group Holdings Limited	25.192	0,49	2.813	Infosys Limited - ADR	49.059	0,95
7.100	Tencent Holdings Limited	348.941	6,80	17.328	Max Healthcare Institute Limited	93.005	1,81
3.000	Wuxi Biologics Cayman Inc.	18.573	0,36	2.697	Reliance Industries Limited	76.498	1,49
Kaimaninseln, insgesamt				Indien, insgesamt			
860.456				16,76			
				829.498			
				16,14			
CHINA				INDONESIEN			
1.138	Bafang Electric Suzhou Company Limited	17.546	0,34	109.700	Bank BTPN Syariah Tbk PT	16.022	0,31
34.200	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	145.022	2,82	267.200	Bank Central Asia Tbk PT	155.921	3,04
11.300	Midea Group Company Limited - A	88.543	1,72	649.036	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	204.735	3,99
2.400	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	108.937	2,12	Indonesien, insgesamt			
35.800	Songcheng Performance Development Company Limited	84.818	1,65	376.678			
20.900	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	78.368	1,53	7,34			
China, insgesamt				JERSEY - KANALINSELN			
523.234				414			
10,18				WNS Holdings Limited - ADR			
				38.572			
				0,75			
				Jersey - Kanalinseln, insgesamt			
				38.572			
				0,75			
ZYPERN				KASACHSTAN			
1.129	Ozon Holdings plc**	0	0,00	625	Kaspi.KZ JSC	47.188	0,92
545	TCS Group Holding plc - Reg**	0	0,00	Kasachstan, insgesamt			
Zypern, insgesamt				47.188			
0				0,92			
GRIECHENLAND				LUXEMBURG			
27.470	Eurobank Ergasias Services and Holdings SA	36.321	0,71	196	Globant SA	32.146	0,63
				Luxemburg, insgesamt			
				32.146			
				0,63			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
MEXIKO				BRITISCHE JUNGFERNNINSELN			
10.905	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	91.740	1,79	12.165	Fix Price Group Limited**	0	0,00
21.245	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	84.751	1,65		Britische Jungferninseln, insgesamt	0	0,00
	Mexiko, insgesamt	176.491	3,44		Aktien, insgesamt	4.832.155	94,08
SÜDKOREA				Rechte			
742	Hana Financial Group Inc.	23.197	0,45	BRASILIEN			
64	Samsung Biologics Company Limited	38.739	0,75	50	Localiza Rent a Car SA Right	129	0,00
602	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	70.612	1,37		Brasilien, insgesamt	129	0,00
5.697	Samsung Electronics Company Limited	280.070	5,45		Rechte, insgesamt	129	0,00
189	Samsung Sdi Company Limited	106.706	2,08	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt			
979	SK Hynix Inc.	66.628	1,30		Börsennotierung, insgesamt	4.832.284	94,08
	Südkorea, insgesamt	585.952	11,40		Wert der Anlagen, insgesamt	4.832.284	94,08
SÜDAFRIKA				(Gesamtkosten: USD 5.440.926)			
4.303	Absa Group Limited	44.086	0,86	<i>*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.</i>			
807	Capitec Bank Holdings Limited	76.763	1,50	<i>**Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.</i>			
6.081	Shoprite Holdings Limited	76.177	1,48				
	Südafrika, insgesamt	197.026	3,84				
TAIWAN							
6.475	Advantech Company Limited	78.896	1,54				
11.000	Delta Electronics Inc.	108.743	2,12				
4.094	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited - ADR	380.824	7,41				
	Taiwan, insgesamt	568.463	11,07				
THAILAND							
12.200	Kasikornbank pcl	47.273	0,92				
	Thailand, insgesamt	47.273	0,92				
VEREINIGTE STAATEN							
60	Mercadolibre Inc.	79.084	1,54				
	Vereinigte Staaten, insgesamt	79.084	1,54				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
KANADA				JAPAN (Fortsetzung)			
268.384	Waste Connections Inc.	37.324.163	2,00	213.600	Sony Group Corp.	19.235.068	1,03
	Kanada, insgesamt	37.324.163	2,00		Japan, insgesamt	152.061.151	8,17
DÄNEMARK				SINGAPUR			
118.512	Novo Nordisk AS	18.767.511	1,01	682.200	DBS Group Holdings Limited	16.932.492	0,91
	Dänemark, insgesamt	18.767.511	1,01		Singapur, insgesamt	16.932.492	0,91
FRANKREICH				SCHWEIZ			
306.535	Legrand SA	28.001.579	1,50	127.417	Lonza Group AG - Reg	76.348.395	4,10
65.362	L'Oreal SA	29.203.909	1,57	302.050	Nestle SA - Reg	36.852.386	1,98
42.113	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	38.634.398	2,08		Schweiz, insgesamt	113.200.781	6,08
350.276	Schneider Electric SE	58.484.055	3,15				
	Frankreich, insgesamt	154.323.941	8,30				
HONGKONG				TAIWAN			
2.430.800	AIA Group Limited	25.593.166	1,37	2.432.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	42.572.936	2,29
	Hongkong, insgesamt	25.593.166	1,37		Taiwan, insgesamt	42.572.936	2,29
INDIEN				VEREINIGTES KÖNIGREICH			
4.490.784	HDFC Bank Limited	87.952.024	4,73	741.930	Compass Group plc	18.649.916	1,00
1.711.474	Kotak Mahindra Bank Limited	36.086.975	1,94	975.319	Diageo plc	43.582.425	2,34
	Indien, insgesamt	124.038.999	6,67		Vereinigtes Königreich, insgesamt	62.232.341	3,34
INDONESIEN				VEREINIGTE STAATEN			
33.630.700	Bank Central Asia Tbk PT	19.624.775	1,05	405.255	Alphabet Inc. - A	42.037.101	2,26
60.469.600	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	19.074.754	1,02	233.762	Amphenol Corp.	19.103.031	1,03
	Indonesien, insgesamt	38.699.529	2,07	687.569	Coca Cola Company	42.649.905	2,29
				37.214	Costco Wholesale Corp.	18.490.520	0,99
				136.062	Danaher Corp.	34.293.066	1,84
				80.078	Elevance Health Inc.	36.820.665	1,98
				81.037	Eli Lilly & Company	27.829.727	1,49
				66.411	Hess Corp.	8.788.832	0,47
				169.066	Hilton Worldwide Holdings Inc.	23.816.327	1,28
				309.475	IntercontinentalExchange Inc.	32.275.148	1,73
				111.604	Intuit Inc.	49.756.411	2,67
				93.759	Lam Research Corp.	49.703.521	2,67
				222.910	Marsh & McLennan Companies Inc.	37.125.661	2,00
				439.719	Marvell Technology Inc.	19.039.833	1,02
				274.086	Mastercard Inc. - A	99.605.593	5,36
				12.708	Mettler-Toledo International Inc.	19.445.909	1,04
				539.239	Microsoft Corp.	155.462.603	8,36

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
89.886	NVIDIA Corp.	24.967.634	1,34
244.156	ON Semiconductor Corp.	20.098.922	1,08
144.850	QUALCOMM Inc.	18.479.963	0,99
129.149	Thermo Fisher Scientific Inc.	74.437.609	4,00
223.821	T-Mobile USA Inc.	32.418.234	1,74
88.015	Union Pacific Corp.	17.713.899	0,95
212.107	Zoetis Inc.	35.303.089	1,90
	Vereinigte Staaten, insgesamt	939.663.203	50,48
	Aktien, insgesamt	1.820.232.719	97,78
	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	1.820.232.719	97,78

Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren

Fonds

IRLAND

33.597.075	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	33.597.075	1,80
	Irland, insgesamt	33.597.075	1,80
	Fonds, insgesamt	33.597.075	1,80
	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt	33.597.075	1,80
	Wert der Anlagen, insgesamt	1.853.829.794	99,58

(Gesamtkosten: USD 1.698.866.084)

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BRASILIEN				CHINA (Fortsetzung)			
1.562.294	B3 SA Brasil Bolsa Balcao	3.189.142	0,90	490.000	Midea Group Company Limited - A	3.839.495	1,09
542.341	Banco BTG Pactual SA	2.101.870	0,59	113.500	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	5.151.832	1,46
149.691	Banco do Brasil SA	1.154.660	0,33	1.853.200	Songcheng Performance Development Company Limited	4.390.610	1,24
1.112.908	Itau Unibanco Holding SA - ADR	5.419.862	1,53	959.400	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	3.597.427	1,02
541.534	Localiza Rent a Car SA	5.703.452	1,61		China, insgesamt	34.223.042	9,68
747.199	Petro Rio SA	4.596.449	1,30				
1.122.219	Sendas Distribuidora SA	3.439.532	0,97				
244.783	Weg SA	1.957.685	0,55				
	Brasilien, insgesamt	27.562.652	7,78				
KANADA				ZYPERN			
177.889	Parex Resources Inc.	3.304.488	0,93	31.029	Ozon Holdings plc**	0	0,00
	Kanada, insgesamt	3.304.488	0,93	12.232	TCS Group Holding plc - Reg**	0	0,00
					Zypern, insgesamt	0	0,00
KAIMANINSELN				GRIECHENLAND			
19.390	Afyra Limited	216.392	0,06	1.570.968	Eurobank Ergasias Services and Holdings SA	2.077.149	0,59
305.030	Full Truck Alliance Company Limited	2.321.278	0,66	467.973	National Bank of Greece SA	2.272.679	0,64
120.857	JD.com Inc.	2.648.087	0,75		Griechenland, insgesamt	4.349.828	1,23
156.512	JD.com Inc. - ADR	6.869.312	1,94				
857.000	Kingdee International Software Group Company Limited	1.388.673	0,39	HONGKONG			
239.800	Kuaishou Technology	1.846.619	0,52	174.400	AIA Group Limited	1.836.205	0,52
751.000	Li Ning Company Limited	5.921.921	1,67	34.500	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.530.311	0,43
539.720	Meituan	9.866.255	2,79	77.500	Techtronic Industries Company	837.694	0,24
445.470	NetEase Inc.	7.831.221	2,21		Hongkong, insgesamt	4.204.210	1,19
64.285	PDD Holdings Inc.	4.879.232	1,38				
171.600	Shenzhou International Group Holdings Limited	1.801.260	0,51	INDIEN			
499.700	Tencent Holdings Limited	24.558.593	6,94	96.264	Apollo Hospitals Enterprise Limited	5.049.531	1,43
224.000	Wuxi Biologics Cayman Inc.	1.386.808	0,39	326.704	AU Small Finance Bank Limited	2.302.514	0,65
	Kaimaninseln, insgesamt	71.535.651	20,21	492.572	Cholamandalam Investment and Finance Company Limited	4.562.940	1,30
CHINA				92.540	Eicher Motors Limited	3.320.484	0,94
264.400	Alibaba Group Holding Limited	3.381.638	0,96	193.900	HDFC Bank Limited - ADR	12.927.312	3,65
51.454	Bafang Electric Suzhou Company Limited	793.320	0,22	569.062	ICICI Bank Limited - ADR	12.280.357	3,47
332.200	Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Company Limited - A	1.619.572	0,46	242.183	Larsen & Toubro Limited	6.377.644	1,80
188.800	China Tourism Group Duty Free Corp. Limited	5.037.758	1,42	230.626	Mahindra & Mahindra Limited	3.251.610	0,92
74.700	Eastroc Beverage Group Company Limited	2.092.971	0,59	185.522	Reliance Industries Limited	5.262.186	1,49
1.018.400	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	4.318.419	1,22		Indien, insgesamt	55.334.578	15,65
				INDONESIEN			
				9.280.100	Astra International Tbk PT	3.713.339	1,05
				15.389.200	Bank BTPN Syariah Tbk PT	2.247.610	0,64

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
INDONESIEN (Fortsetzung)				POLEN			
16.867.300	Bank Central Asia Tbk PT	9.842.702	2,78	37.219	Dino Polska SA	3.378.878	0,96
32.437.166	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	10.232.100	2,89		Polen, insgesamt	3.378.878	0,96
	Indonesien, insgesamt	26.035.751	7,36				
JERSEY - KANALINSELN				SÜDKOREA			
19.385	WNS Holdings Limited - ADR	1.806.100	0,51	52.283	Hana Financial Group Inc.	1.634.539	0,46
	Jersey - Kanalinseln, insgesamt	1.806.100	0,51	2.938	Samsung Biologics Company Limited	1.778.355	0,50
KASACHSTAN				41.984	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	4.924.512	1,39
21.388	Kaspi.KZ JSC	1.614.794	0,46	414.441	Samsung Electronics Company Limited	20.374.317	5,76
	Kasachstan, insgesamt	1.614.794	0,46	8.394	Samsung Sdi Company Limited	4.739.109	1,34
LUXEMBURG				69.138	SK Hynix Inc.	4.705.339	1,33
13.715	Globant SA	2.249.398	0,64		Südkorea, insgesamt	38.156.171	10,78
	Luxemburg, insgesamt	2.249.398	0,64	SÜDAFRIKA			
MALAYSIA				303.032	Absa Group Limited	3.104.710	0,88
1.228.000	Public Bank Bhd	1.113.202	0,31	32.605	Capitec Bank Holdings Limited	3.101.439	0,88
	Malaysia, insgesamt	1.113.202	0,31	188.911	Shoprite Holdings Limited	2.366.492	0,67
MEXIKO					Südafrika, insgesamt	8.572.641	2,43
119.381	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV - B	2.318.120	0,66	TAIWAN			
778.964	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	6.553.173	1,85	443.000	Delta Electronics Inc.	4.379.384	1,24
1.093.027	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	4.360.344	1,23	287.770	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited - ADR	26.768.366	7,57
	Mexiko, insgesamt	13.231.637	3,74		Taiwan, insgesamt	31.147.750	8,81
NIEDERLANDE				THAILAND			
33.179	Yandex NV - A**	0	0,00	845.900	Kasikornbank plc	3.277.719	0,93
	Niederlande, insgesamt	0	0,00		Thailand, insgesamt	3.277.719	0,93
PHILIPPINEN				VEREINIGTE STAATEN			
2.364.500	Ayala Land Inc.	1.152.554	0,33	163.012	Coupang Inc.	2.608.192	0,74
695.860	BDO Unibank Inc.	1.644.755	0,47	4.259	Mercadolibre Inc.	5.613.618	1,59
	Philippinen, insgesamt	2.797.309	0,80		Vereinigte Staaten, insgesamt	8.221.810	2,33
				BRITISCHE JUNGFERNINSELN			
				223.974	Fix Price Group Limited**	0	0,00
					Britische Jungferninseln, insgesamt	0	0,00
				Aktien, insgesamt		342.117.609	96,73

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Rechte			
BRASILIEN			
2.423	Localiza Rent a Car SA Right	6.275	0,00
	Brasilien, insgesamt	6.275	0,00
	Rechte, insgesamt	6.275	0,00
	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	342.123.884	96,73
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
Aktien			
RUSSISCHE FÖDERATION			
597.602	Detsky Mir PJSC**	0	0,00
	Russische Föderation, insgesamt	0	0,00
	Aktien, insgesamt	0	0,00
	Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt	0	0,00
	Wert der Anlagen, insgesamt	342.123.884	96,73

(Gesamtkosten: USD 349.263.838)

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

**Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.

Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
AUSTRALIEN				HONGKONG (Fortsetzung)			
597.016	Telstra Corp. Limited	1.687.373	1,00	39.900	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.769.838	1,05
	Australien, insgesamt	1.687.373	1,00		Hongkong, insgesamt	4.374.638	2,59
KANADA				IRLAND			
19.709	Canadian National Railway Company	2.322.380	1,38	29.585	CRH plc	1.493.828	0,89
87.953	Suncor Energy Inc.	2.726.942	1,62	100.895	Experian plc	3.318.393	1,97
	Kanada, insgesamt	5.049.322	3,00	7.593	Linde plc	2.698.856	1,60
				30.886	Medtronic plc	2.490.029	1,48
					Irland, insgesamt	10.001.106	5,94
KAIMANINSELN				JAPAN			
20.487	NetEase Inc. - ADR	1.811.870	1,08	20.200	Rohm Company Limited	1.664.993	0,99
	Kaimaninseln, insgesamt	1.811.870	1,08	4.400	SMC Corp.	2.308.602	1,37
CHINA				8.100	Tokyo Electron Limited	976.211	0,58
278.292	Ping An Insurance Group Company of China Limited	1.811.563	1,08	755.600	Z Holdings Corp.	2.116.520	1,26
	China, insgesamt	1.811.563	1,08		Japan, insgesamt	7.066.326	4,20
DÄNEMARK				JERSEY - KANALINSELN			
54.473	Tryg A/S	1.190.906	0,71	86.397	WPP plc	1.024.030	0,61
	Dänemark, insgesamt	1.190.906	0,71		Jersey - Kanalinseln, insgesamt	1.024.030	0,61
FRANKREICH				NIEDERLANDE			
41.692	AXA SA	1.275.770	0,76	26.662	Akzo Nobel NV	2.085.040	1,24
47.507	BNP Paribas SA	2.849.608	1,69		Niederlande, insgesamt	2.085.040	1,24
2.469	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	2.265.057	1,35	NORWEGEN			
13.968	Schneider Electric SE	2.332.176	1,38	56.796	Equinor ASA	1.619.866	0,96
65.533	TotalEnergies SE	3.870.341	2,30		Norwegen, insgesamt	1.619.866	0,96
	Frankreich, insgesamt	12.592.952	7,48	SÜDKOREA			
DEUTSCHLAND				86.399	Samsung Electronics Company Limited	4.247.458	2,51
157.154	Deutsche Telekom AG - Reg	3.816.039	2,27		Südkorea, insgesamt	4.247.458	2,51
197.536	E.ON SE	2.468.049	1,47	SPANIEN			
80.910	Evonik Industries AG	1.701.834	1,01	62.297	Inditex SA	2.091.392	1,24
25.452	SAP SE	3.209.329	1,91		Spanien, insgesamt	2.091.392	1,24
25.715	Siemens AG - Reg	4.170.035	2,48	SCHWEDEN			
	Deutschland, insgesamt	15.365.286	9,14	77.692	Sandvik AB	1.646.809	0,98
HONGKONG					Schweden, insgesamt	1.646.809	0,98
247.400	AIA Group Limited	2.604.800	1,54				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Select

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
AUSTRALIEN				IRLAND (Fortsetzung)			
27.541	CSL Limited	5.317.862	0,93	27.388	Linde plc	9.734.791	1,70
	Australien, insgesamt	5.317.862	0,93		Irland, insgesamt	14.663.440	2,56
KANADA				JAPAN			
64.965	Nutrien Limited	4.791.189	0,84	16.900	Keyence Corp.	8.183.971	1,43
	Kanada, insgesamt	4.791.189	0,84	122.400	Recruit Holdings Company Limited	3.356.825	0,59
				63.900	Sony Group Corp.	5.754.311	1,00
DÄNEMARK					Japan, insgesamt	17.295.107	3,02
43.410	Novo Nordisk AS	6.874.390	1,20	NIEDERLANDE			
77.273	Orsted A/S	6.574.893	1,15	54.912	Akzo Nobel NV	4.294.265	0,75
	Dänemark, insgesamt	13.449.283	2,35	37.663	Koninklijke DSM NV	4.447.892	0,78
FRANKREICH					Niederlande, insgesamt	8.742.157	1,53
192.403	AXA SA	5.887.506	1,03	NORWEGEN			
32.403	EssilorLuxottica SA	5.843.904	1,02	238.971	Equinor ASA	6.815.637	1,19
17.196	L'Oreal SA	7.683.217	1,34		Norwegen, insgesamt	6.815.637	1,19
6.914	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	6.342.893	1,11	SÜDKOREA			
50.484	Schneider Electric SE	8.429.093	1,47	12.736	Samsung Sdi Company Limited	7.190.528	1,26
290.809	TotalEnergies SE	17.175.012	2,99		Südkorea, insgesamt	7.190.528	1,26
	Frankreich, insgesamt	51.361.625	8,96	SINGAPUR			
DEUTSCHLAND				328.900	DBS Group Holdings Limited	8.163.437	1,43
24.025	Adidas AG	4.248.877	0,74		Singapur, insgesamt	8.163.437	1,43
	Deutschland, insgesamt	4.248.877	0,74	SCHWEIZ			
HONGKONG				9.648	Lonza Group AG - Reg	5.781.091	1,01
760.600	AIA Group Limited	8.008.130	1,40	89.945	Nestle SA - Reg	10.973.971	1,92
	Hongkong, insgesamt	8.008.130	1,40		Schweiz, insgesamt	16.755.062	2,93
INDIEN				TAIWAN			
599.482	HDFC Bank Limited	11.740.857	2,05	770.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	13.479.095	2,35
226.120	Kotak Mahindra Bank Limited	4.767.812	0,83		Taiwan, insgesamt	13.479.095	2,35
	Indien, insgesamt	16.508.669	2,88	VEREINIGTES KÖNIGREICH			
INDONESIEN				139.798	Anglo American plc	4.629.010	0,81
27.351.774	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	8.627.945	1,51	159.926	Diageo plc	7.146.342	1,25
	Indonesien, insgesamt	8.627.945	1,51	278.081	Shell plc	7.937.391	1,39
IRLAND							
97.611	CRH plc	4.928.649	0,86				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Select

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Aktien (Fortsetzung)				Fonds			
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				IRLAND			
168.684	SSE plc	3.760.505	0,66	14.622.250	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	14.622.250	2,55
	Vereinigtes Königreich, insgesamt	23.473.248	4,11		Irland, insgesamt	14.622.250	2,55
VEREINIGTE STAATEN				Fonds, insgesamt			
53.562	Abbott Laboratories	5.423.688	0,95	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt			
19.908	Adobe Inc.	7.671.946	1,34	14.622.250 2,55			
57.522	Advanced Micro Devices Inc.	5.637.731	0,98	Wert der Anlagen, insgesamt			
233.759	Alphabet Inc. - A	24.247.821	4,23	581.342.531 101,50			
202.645	Amazon.com Inc.	20.931.201	3,65	(Gesamtkosten: USD 533.797.154)			
24.815	Autodesk Inc.	5.165.490	0,90	<i>*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.</i>			
17.172	Cooper Companies Inc.	6.411.338	1,12				
30.150	CrowdStrike Holdings Inc. - A	4.138.389	0,72				
12.933	Deere & Company	5.339.777	0,93				
59.380	Ecolab Inc.	9.829.171	1,71				
67.079	Electronic Arts Inc.	8.079.666	1,41				
15.907	Elevance Health Inc.	7.314.198	1,28				
33.490	Eli Lilly & Company	11.501.136	2,01				
7.924	Equinix Inc.	5.713.521	1,00				
56.676	IntercontinentalExchange Inc.	5.910.740	1,03				
28.507	Intuit Inc.	12.709.276	2,22				
95.399	JPMorgan Chase & Company	12.431.443	2,16				
17.180	Lam Research Corp.	9.107.462	1,59				
51.335	Mastercard Inc. - A	18.655.652	3,26				
5.404	Mercadolibre Inc.	7.122.796	1,24				
102.048	Micron Technology Inc.	6.157.576	1,08				
113.826	Microsoft Corp.	32.816.035	5,72				
96.013	NextEra Energy Inc.	7.400.683	1,29				
29.806	NVIDIA Corp.	8.279.213	1,45				
72.536	ON Semiconductor Corp.	5.971.164	1,04				
56.991	Paypal Holdings Inc.	4.327.897	0,76				
53.940	PepsiCo Inc.	9.833.262	1,71				
75.828	QUALCOMM Inc.	9.674.135	1,69				
21.792	Stryker Corp.	6.220.962	1,09				
15.950	Thermo Fisher Scientific Inc.	9.193.101	1,61				
115.502	T-Mobile USA Inc.	16.729.310	2,92				
111.687	Trimble Inc.	5.854.633	1,02				
246.713	Uber Technologies Inc.	7.820.802	1,37				
39.781	Union Pacific Corp.	8.006.324	1,40				
61.934	Walt Disney Company	6.201.451	1,08				
	Vereinigte Staaten, insgesamt	337.828.990	58,96				
	Aktien, insgesamt	566.720.281	98,95				
	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	566.720.281	98,95				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BELGIEN				JAPAN (Fortsetzung)			
173.340	Azelis Group NV	4.049.222	0,24	332.500	Mani Inc.	4.152.925	0,25
1.562	Lotus Bakeries NV	10.074.900	0,60	750.440	Shoei Company Limited	14.396.838	0,85
	Belgien, insgesamt	14.124.122	0,84	1.177.000	SMS Company Limited	26.007.105	1,54
				446.710	Square Enix Holdings Company Limited	19.648.413	1,16
KANADA				Japan, insgesamt			
262.597	Cargojet Inc.	19.661.546	1,17			128.087.411	7,60
	Kanada, insgesamt	19.661.546	1,17	NIEDERLANDE			
DÄNEMARK				339.511	BE Semiconductor Industries NV	27.194.831	1,61
1.530.665	ALK-Abello AS	21.801.196	1,29	173.267	IMCD NV	26.059.357	1,55
	Dänemark, insgesamt	21.801.196	1,29	Niederlande, insgesamt			
FINNLAND						53.254.188	3,16
283.948	Revenio Group Oyj	10.971.751	0,65	SPANIEN			
	Finnland, insgesamt	10.971.751	0,65	847.223	Fluidra SA	13.716.540	0,81
FRANKREICH				Spanien, insgesamt			
325.266	Lectra	11.823.419	0,70			13.716.540	0,81
169.043	Remy Cointreau SA	28.399.224	1,68	SCHWEDEN			
	Frankreich, insgesamt	40.222.643	2,38	2.892.838	Fortnox AB	18.210.517	1,08
DEUTSCHLAND				576.923	Hemnet Group AB	8.941.112	0,53
499.674	CTS Eventim AG & Company KGaA	28.706.271	1,71	367.751	MIPS AB	17.091.609	1,01
521.346	Nemetschek SE	32.990.775	1,96	771.711	Nordnet AB publ	11.696.202	0,69
26.022	Rational AG	16.055.574	0,95	722.214	Thule Group AB	16.327.673	0,97
76.043	STRATEC SE	4.760.292	0,28	Schweden, insgesamt			
	Deutschland, insgesamt	82.512.912	4,90			72.267.113	4,28
ITALIEN				SCHWEIZ			
199.463	Diasorin SpA	19.359.879	1,15	44.702	Belimo Holding AG	19.862.026	1,18
753.168	Stevanato Group SpA	17.954.854	1,06	22.462	Inficon Holding AG	22.336.935	1,32
1.941.852	Technoprobe SpA	12.948.269	0,77	4.362	LEM Holding SA	8.640.267	0,51
	Italien, insgesamt	50.263.002	2,98	1.141.414	SIG Group AG	27.048.209	1,60
JAPAN				159.849	SKAN Group AG	13.480.108	0,80
459.200	Asahi Intecc Company Limited	7.380.447	0,44	59.108	Tecan Group AG - Reg	23.773.592	1,41
531.900	Capcom Company Limited	17.417.855	1,03	80.485	VAT Group AG	26.614.084	1,58
514.600	Daiseki Company Limited	14.929.541	0,89	Schweiz, insgesamt			
90.585	Disco Corp.	9.585.006	0,57			141.755.221	8,40
498.200	Japan Elevator Service Holdings Company Limited	7.400.868	0,44	VEREINIGTES KÖNIGREICH			
211.535	Jtower Inc.	7.168.413	0,43	1.604.445	Abcam plc	19.877.426	1,17
				1.414.269	Auction Technology Group plc	9.882.509	0,59
				689.486	Future plc	9.094.435	0,54
				272.823	Games Workshop Group plc	29.931.248	1,77
				509.334	Genus plc	16.659.281	0,99
				485.619	Keywords Studios plc	15.242.519	0,90
				250.520	Renishaw plc	11.672.317	0,69

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
2.139.607	Watches of Switzerland Group plc	19.857.509	1,18	83.914	Visteon Corp.	12.113.059	0,72
	Vereinigtes Königreich, insgesamt	132.217.244	7,83	96.723	WD-40 Company	15.851.194	0,94
				496.455	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	21.421.888	1,27
				364.434	Workiva Inc.	34.351.959	2,04
				119.969	XPEL Inc.	7.503.239	0,44
				224.776	YETI Holdings Inc.	8.275.613	0,49
					Vereinigte Staaten, insgesamt	879.730.318	52,17
					Aktien, insgesamt	1.660.585.207	98,46
					Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	1.660.585.207	98,46
					Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren		
					Fonds		
					IRLAND		
				26.602.496	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	24.485.707	1,45
					Irland, insgesamt	24.485.707	1,45
					Fonds, insgesamt	24.485.707	1,45
					Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt	24.485.707	1,45
					Wert der Anlagen, insgesamt	1.685.070.914	99,91
					(Gesamtkosten: EUR 1.703.395.198)		
					<i>*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.</i>		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
KAIMANINSELN				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
252.441	Globalfoundries Inc.	18.221.191	1,72	225.942	QUALCOMM Inc.	28.825.681	2,72
	Kaimaninseln, insgesamt	18.221.191	1,72	83.473	Republic Services Inc.	11.287.219	1,07
CURAÇAO				15.291	S&P Global Inc.	5.271.878	0,50
154.738	Schlumberger Limited	7.597.636	0,72	98.400	Salesforce Inc.	19.658.352	1,86
	Curacao, insgesamt	7.597.636	0,72	65.688	Sherwin-Williams Company	14.764.692	1,40
SCHWEIZ				167.556	Stanley Black & Decker Inc.	13.501.662	1,28
236.623	TE Connectivity Limited	31.033.106	2,93	442.203	State Street Corp.	33.470.345	3,17
	Schweiz, insgesamt	31.033.106	2,93	299.508	Take-Two Interactive Software Inc.	35.731.304	3,38
VEREINIGTE STAATEN				77.779	Teradyne Inc.	8.362.020	0,79
161.246	Advanced Micro Devices Inc.	15.803.720	1,49	71.503	TransUnion	4.443.196	0,42
721.542	AES Corp.	17.374.731	1,64	177.902	Trimble Inc.	9.325.623	0,88
145.921	Alphabet Inc. - A	15.136.385	1,43	538.410	Uber Technologies Inc.	17.067.597	1,61
315.537	Amazon.com Inc.	32.591.817	3,08	46.243	Union Pacific Corp.	9.306.866	0,88
94.949	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	9.232.841	0,87	95.802	United Parcel Service Inc.	18.584.630	1,76
338.334	Bristol-Myers Squibb Company	23.449.929	2,21	63.571	Vertex Pharmaceuticals Inc.	20.029.314	1,89
36.356	Broadcom Inc.	23.323.829	2,20	398.029	Virtu Financial Inc.	7.522.748	0,71
113.542	Catalent Inc.	7.460.845	0,71	441.703	Voya Financial Inc.	31.564.096	2,98
16.834	Cigna Group	4.301.592	0,41	57.050	Walt Disney Company	5.712.417	0,54
31.184	Cintas Corp.	14.428.214	1,36	403.055	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	18.895.218	1,79
409.101	Coca Cola Company	25.376.535	2,40	39.971	Zebra Technologies Corp.	12.710.778	1,20
97.189	Crowdstrike Holdings Inc. - A	13.340.162	1,26		Vereinigte Staaten, insgesamt	954.610.311	90,23
232.751	Darling International Inc.	13.592.658	1,28		Aktien, insgesamt	1.011.462.244	95,60
94.134	Doximity Inc.	3.048.059	0,29		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	1.011.462.244	95,60
151.739	Electronic Arts Inc.	18.276.963	1,73		Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren		
56.166	Eli Lilly & Company	19.288.528	1,82		Fonds		
479.771	Endeavor Group Holdings Inc.	11.480.920	1,09		IRLAND		
77.476	Exact Sciences Corp.	5.253.648	0,50	43.005.955	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	43.005.955	4,06
86.157	FMC Corp.	10.522.354	0,99		Irland, insgesamt	43.005.955	4,06
29.895	Goldman Sachs Group Inc.	9.778.953	0,92		Fonds, insgesamt	43.005.955	4,06
78.255	Hess Corp.	10.356.267	0,98		Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt	43.005.955	4,06
294.316	Hilton Worldwide Holdings Inc.	41.460.295	3,92		Wert der Anlagen, insgesamt	1.054.468.199	99,66
127.259	Howmet Aerospace Inc.	5.391.964	0,51		(Gesamtkosten: USD 1.001.157.212)		
126.464	IntercontinentalExchange Inc.	13.188.931	1,25				
113.014	Intuitive Surgical Inc.	28.871.687	2,73				
239.150	Kellogg Company	16.013.484	1,52				
47.303	Lam Research Corp.	25.076.267	2,37				
100.697	Lamb Weston Holding Inc.	10.524.850	0,99				
440.188	Marvell Technology Inc.	19.060.141	1,80				
178.794	Microchip Technology Inc.	14.979.361	1,42				
152.548	Microsoft Corp.	43.979.588	4,15				
291.561	Northern Trust Corp.	25.695.271	2,43				
1.851.825	NOV Inc.	34.277.281	3,24				
167.608	Procter & Gamble Company	24.921.634	2,36				
174.040	Prologis Inc.	21.714.971	2,05				

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinventarwerts*		Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinventarwerts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung					Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente					Aktien (Fortsetzung)				
VEREINIGTE STAATEN					VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				
USD	561.486	Liveperson Inc. 0.00%	2.476.153	0,54	123.267	Darling International Inc.	7.198.793	1,56	
					260.018	Domo Inc.	3.689.655	0,80	
		Vereinigte Staaten, insgesamt	2.476.153	0,54	121.873	Doximity Inc.	3.946.248	0,86	
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt					2.476.153 0,54				
Aktien					881.667 Empire State Realty Trust Inc. - A 5.722.019 1,24				
BERMUDAS					171.498 Endeavor Group Holdings Inc. 4.103.947 0,89				
	190.063	Axalta Coating System Limited	5.757.008	1,25	106.551	Envestnet Inc.	6.251.347	1,36	
	215.703	Essent Group Limited	8.638.905	1,87	53.063	FTI Consulting Inc.	10.471.983	2,27	
		Bermudas, insgesamt	14.395.913	3,12	23.068	Herc Holdings Inc.	2.627.445	0,57	
KANADA					16.891 Heska Corp. 1.648.899 0,36				
	137.054	Gildan Activewear Inc.	4.548.822	0,99	316.281	Hostess Brands Inc.	7.869.071	1,71	
	120.986	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	6.810.302	1,48	92.730	Houlihan Lokey Inc.	8.112.948	1,76	
		Kanada, insgesamt	11.359.124	2,47	68.553	ICF International Inc.	7.520.264	1,63	
JERSEY - KANALINSELN					94.894 Insmed Inc. 1.617.943 0,35				
	267.959	Clarivate plc	2.516.135	0,55	51.652	Installed Building Products Inc.	5.889.878	1,28	
		Jersey - Kanalinseln, insgesamt	2.516.135	0,55	266.734	Kontoor Brands Inc.	12.907.259	2,80	
NIEDERLANDE					311.085 Latham Group Inc. 889.703 0,19				
	185.669	Core Laboratories NV	4.094.001	0,89	150.594	Livent Corp.	3.270.902	0,71	
		Niederlande, insgesamt	4.094.001	0,89	148.034	Lyft Inc. - A	1.372.275	0,30	
VEREINIGTE STAATEN					279.790 Matthews International Corp. - A 10.089.227 2,19				
	127.092	Acadia Pharmaceuticals Inc.	2.391.871	0,52	18.337	Medpace Holdings Inc.	3.448.273	0,75	
	93.685	Acushnet Holdings Corp.	4.772.314	1,03	332.029	Moelis & Company - A	12.763.195	2,77	
	226.663	Allogene Therapeutics Inc.	1.119.715	0,24	24.715	Morningstar Inc.	5.017.886	1,09	
	71.099	Applied Industrial Technologies Inc.	10.105.300	2,19	225.710	nCino Inc.	5.593.094	1,21	
	388.814	Aris Water Solutions Inc.	3.028.861	0,66	1.623.257	Newpark Resources	6.249.539	1,36	
	434.895	Avista Corp.	18.461.293	4,00	129.249	NLight Inc.	1.315.755	0,29	
	78.435	Beacon Roofing Supply Inc.	4.615.900	1,00	611.427	NOV Inc.	11.317.515	2,44	
	64.239	Bright Horizons Family Solutions Inc.	4.945.761	1,07	246.571	Nutanix Inc. - A	6.408.381	1,38	
	471.449	Brixmor Property Group Inc.	10.145.582	2,20	226.458	Patterson Companies Inc.	6.062.281	1,31	
	10.792	Cable One Inc.	7.575.984	1,64	61.334	Qualys Inc.	7.974.647	1,73	
	418.972	Carriage Services Inc.	12.787.025	2,76	307.875	Quanex Building Products Corp.	6.628.549	1,44	
	28.849	Casella Waste Systems Inc. - A	2.384.658	0,52	342.146	Quanterix Corp.	3.855.985	0,84	
	67.377	Catalent Inc.	4.427.343	0,96	979.312	Ranpak Holdings Corp.	5.112.009	1,11	
	97.374	Cirrus Logic Inc.	10.650.768	2,31	48.486	Rapid7 Inc.	2.225.992	0,48	
	179.810	Conmed Corp.	18.675.066	4,05	214.831	REVOLUTION Medicines Inc.	4.653.239	1,01	
					24.271	Rogers Corp.	3.966.610	0,86	
					85.778	Sage Therapeutics Inc.	3.599.245	0,78	
					280.023	Schnitzer Steel Industries Inc.	8.708.715	1,89	
					2.068.128	Sharecare Inc.	2.936.742	0,64	
					98.253	Shift4 Payments Inc.	7.447.577	1,61	
					37.811	Simulations Plus Inc.	1.661.415	0,36	
					18.321	SiTime Corp.	2.605.796	0,57	
					73.739	Stanley Black & Decker Inc.	5.941.889	1,29	
					168.756	Teradata Corp.	6.797.492	1,47	
					37.944	Teradyne Inc.	4.079.359	0,88	
					340.083	Utz Brands Inc.	5.601.167	1,21	
					411.071	Virtu Financial Inc.	7.769.242	1,68	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
206.834	Voya Financial Inc.	14.780.358	3,21
107.897	Westrock Company	3.287.622	0,71
285.598	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	13.388.834	2,91
42.136	Wingstop Inc.	7.735.327	1,68
407.409	Xponential Fitness Inc.	12.381.160	2,68
	Vereinigte Staaten, insgesamt	422.602.137	91,62
	Aktien, insgesamt	454.967.310	98,65
	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	457.443.463	99,19

Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren

Fonds

IRLAND

2.289.664	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.289.664	0,50
	Irland, insgesamt	2.289.664	0,50
	Fonds, insgesamt	2.289.664	0,50
	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt	2.289.664	0,50
	Wert der Anlagen, insgesamt	459.733.127	99,69

(Gesamtkosten: USD 456.072.251)

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
AUSTRALIEN				HONGKONG (Fortsetzung)			
21.473	Amcor plc	240.028	0,54	174.500	BOC Hong Kong Holdings Limited	543.508	1,23
65.459	ANZ Group Holdings Limited	1.005.278	2,27	126.400	Galaxy Entertainment Group Limited	844.548	1,90
4.159	CSL Limited	803.057	1,81	522.000	Guangdong Investment Limited	533.971	1,20
32.529	Goodman Group	409.365	0,92	24.221	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.074.368	2,42
3.809	Macquarie Group Limited	448.122	1,01	Hongkong, insgesamt			11,81
52.172	Newcrest Mining Limited	938.198	2,11				
11.726	Rio Tinto Limited	943.518	2,13				
143.371	Santos Limited	662.557	1,49				
149.344	Telstra Corp. Limited	422.098	0,95				
78.850	Transurban Group	750.427	1,69				
	Australien, insgesamt	6.622.648	14,92				
KAIMANINSELN				INDIEN			
182.000	China Mengniu Dairy Company Limited	746.551	1,68	39.414	HDFC Bank Limited	771.923	1,74
14.839	Hesai Group	229.559	0,52	32.252	Infosys Limited	560.388	1,26
78.638	JD.com Inc.	1.723.030	3,88	59.341	Reliance Industries Limited	1.683.161	3,80
52.870	Meituan	966.481	2,18	7.954	Tata Consultancy Services Limited	310.281	0,70
40.800	NetEase Inc.	717.251	1,62	37.370	UPL Limited	326.328	0,74
10.000	Parade Technologies Limited	344.852	0,78	Indien, insgesamt			8,24
25.300	Shenzhou International Group Holdings Limited	265.570	0,60				
65.300	Sunny Optical Technology Group Company Limited	789.842	1,78				
32.900	Tencent Holdings Limited	1.616.926	3,64				
	Kaimaninseln, insgesamt	7.400.062	16,68				
CHINA				INDONESIEN			
184.516	Alibaba Group Holding Limited	2.359.933	5,33	499.600	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	332.350	0,75
18.000	BYD Company Limited	526.932	1,19	Indonesien, insgesamt			0,75
3.486.600	China Construction Bank Corp.	2.260.747	5,09				
18.600	China Tourism Group Duty Free Corp. Limited	496.305	1,12				
102.100	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	432.944	0,98				
65.100	Midea Group Company Limited - A	510.104	1,15				
171.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	1.116.393	2,52				
17.100	Wuliangye Yibin Company Limited - A	490.543	1,11				
	China, insgesamt	8.193.901	18,49				
HONGKONG				SÜDKOREA			
213.400	AIA Group Limited	2.246.824	5,06	3.005	Kia Corp.	186.969	0,42
				964	LG Chem Limited P.P. 144A	527.227	1,18
				5.067	Naver Corp.	786.217	1,77
				45.056	Samsung Electronics Company Limited	2.214.996	4,99
				704	Samsung Sdi Company Limited	397.466	0,90
				20.349	SK Hynix Inc.	1.384.896	3,12
				12.450	SK Telecom Company Limited	461.909	1,04
				Südkorea, insgesamt			13,42
				SINGAPUR			
				186.900	Singapore Telecommunications Limited	345.812	0,78
				23.200	United Overseas Bank Limited	519.297	1,17
				Singapur, insgesamt			1,95
				TAIWAN			
				219.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	3.833.665	8,65

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
TAIWAN (Fortsetzung)			
36.000	Yageo Corp.	625.462	1,41
	Taiwan, insgesamt	4.459.127	10,06
THAILAND			
52.500	Kasikornbank pcl	203.429	0,46
	Thailand, insgesamt	203.429	0,46
	Aktien, insgesamt	42.931.606	96,78
	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	42.931.606	96,78
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Fonds			
IRLAND			
18.558	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	18.558	0,04
	Irland, insgesamt	18.558	0,04
	Fonds, insgesamt	18.558	0,04
	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt	18.558	0,04
	Wert der Anlagen, insgesamt	42.950.164	96,82
	(Gesamtkosten: USD 41.862.008)		

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
AUSTRALIEN				HONGKONG			
165.677	ANZ Group Holdings Limited	2.544.363	2,17	406.400	AIA Group Limited	4.278.864	3,65
228.651	Chalice Mining Limited	1.147.011	0,98	432.000	BOC Hong Kong Holdings Limited	1.345.534	1,15
13.947	CSL Limited	2.693.012	2,30	384.000	Galaxy Entertainment Group Limited	2.565.717	2,19
733.851	Deterra Royalties Limited	2.359.184	2,01	39.337	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.744.865	1,49
121.316	IGO Limited	1.037.580	0,89	826.000	Lenovo Group Limited	894.398	0,76
20.118	Macquarie Group Limited	2.366.848	2,02	128.500	Sun Hung Kai Properties Limited	1.800.644	1,54
30.471	Mineral Resources Limited	1.644.677	1,40	41.661	Techtronic Industries Company	450.312	0,38
304.829	Santos Limited	1.408.699	1,20				
157.974	Transurban Group	1.503.462	1,28				
	Australien, insgesamt	16.704.836	14,25		Hongkong, insgesamt	13.080.334	11,16
KAIMANINSELN				INDIEN			
385.000	China Mengniu Dairy Company Limited	1.579.242	1,35	157.652	Bharti Airtel Limited	1.436.814	1,22
546.816	China Resources Land Limited	2.493.768	2,13	136.622	HDFC Bank Limited	2.675.742	2,28
35.792	Hesai Group	553.702	0,47	286.116	ICICI Bank Limited	3.054.109	2,62
71.785	JD.com Inc.	1.572.875	1,34	106.853	Infosys Limited	1.856.602	1,59
17.500	Li Ning Company Limited	137.994	0,12	107.198	Reliance Industries Limited	3.040.587	2,60
86.693	Meituan	1.584.776	1,35	200.460	UPL Limited	1.750.490	1,50
44.000	Parade Technologies Limited	1.517.347	1,30				
113.600	Sunny Optical Technology Group Company Limited	1.374.059	1,17		Indien, insgesamt	13.814.344	11,81
98.500	Tencent Holdings Limited	4.840.947	4,14				
21.300	Trip.com Group Limited	797.193	0,68		INDONESIEN		
37.000	Wuxi Biologics Cayman Inc.	229.071	0,20	8.969.956	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	2.829.516	2,42
	Kaimaninseln, insgesamt	16.680.974	14,25		Indonesien, insgesamt	2.829.516	2,42
CHINA				MALAYSIA			
223.628	Alibaba Group Holding Limited	2.860.170	2,45	1.034.300	CIMB Group Holdings Bhd	1.244.677	1,06
25.000	BYD Company Limited	731.850	0,62		Malaysia, insgesamt	1.244.677	1,06
3.316.000	China Construction Bank Corp.	2.150.128	1,84				
214.500	China Merchants Bank Company Limited - H	1.095.730	0,94		PHILIPPINEN		
44.100	China Tourism Group Duty Free Corp. Limited	1.176.722	1,00	1.162.525	Metropolitan Bank & Trust Company	1.250.934	1,07
256.000	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	1.085.541	0,93		Philippinen, insgesamt	1.250.934	1,07
245.500	NARI Technology Company Limited	969.161	0,83				
302.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	1.965.893	1,68		SÜDKOREA		
466.100	Songcheng Performance Development Company Limited	1.104.286	0,94	29.219	Kia Corp.	1.817.987	1,56
59.177	Wuliangye Yibin Company Limited - A	1.697.595	1,45	36.094	KT Corp.	816.508	0,70
	China, insgesamt	14.837.076	12,68	2.469	LG Chem Limited P.P. 144A	1.350.335	1,15
				4.639	Lotte Chilsung Beverage Company Limited	587.605	0,50
				2.016	Samsung Biologics Company Limited	1.220.273	1,04

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asia Equities

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Aktien (Fortsetzung)				Fonds			
SÜDKOREA (Fortsetzung)				IRLAND			
108.436	Samsung Electronics Company Limited	5.330.818	4,55	14.119	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	14.119	0,01
2.875	Samsung Sdi Company Limited	1.623.176	1,39		Irland, insgesamt	14.119	0,01
18.234	SK Hynix Inc.	1.240.955	1,06		Fonds, insgesamt	14.119	0,01
	Südkorea, insgesamt	13.987.657	11,95		Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt	14.119	0,01
SINGAPUR					Wert der Anlagen, insgesamt	115.440.088	98,58
219.700	Keppel Corp. Limited	930.323	0,79		(Gesamtkosten: USD 109.237.239)		
108.500	United Overseas Bank Limited	2.428.611	2,07				
	Singapur, insgesamt	3.358.934	2,86				
TAIWAN							
256.550	Chailease Holding Company Limited	1.883.183	1,61				
188.000	Chroma ATE Inc.	1.095.971	0,94				
132.000	Delta Electronics Inc.	1.304.918	1,11				
548.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	9.592.914	8,20				
70.000	Yageo Corp.	1.216.176	1,03				
	Taiwan, insgesamt	15.093.162	12,89				
THAILAND							
712.663	Thai Oil pcl	1.094.159	0,93				
	Thailand, insgesamt	1.094.159	0,93				
VEREINIGTE STAATEN							
23.050	Yum China Holdings Inc.	1.449.366	1,24				
	Vereinigte Staaten, insgesamt	1.449.366	1,24				
	Aktien, insgesamt	115.425.969	98,57				
	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	115.425.969	98,57				

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
53.862	ZoomInfo Technologies Inc.	1.330.930	0,50
	Vereinigte Staaten, insgesamt	248.362.598	92,75
	Aktien, insgesamt	260.750.521	97,36
	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	260.750.521	97,36
	Wert der Anlagen, insgesamt	260.750.521	97,36
	(Gesamtkosten: USD 209.689.959)		

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
IRLAND				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
608	Aon plc	191.696	0,15	20.809	Hologic Inc.	1.679.286	1,32
	Irland, insgesamt	191.696	0,15	63.118	Host Hotels & Resorts Inc.	1.040.816	0,82
VEREINIGTE STAATEN				1.129	Humana Inc.	548.084	0,43
14.383	Abbott Laboratories	1.456.423	1,15	9.657	IQVIA Holdings Inc.	1.920.681	1,51
8.226	AbbVie Inc.	1.310.978	1,03	42.045	Kroger Company	2.075.762	1,63
4.199	Adobe Inc.	1.618.169	1,27	3.175	Lam Research Corp.	1.683.131	1,32
21.628	Advanced Micro Devices Inc.	2.119.760	1,67	12.909	Lennar Corp.	1.356.865	1,06
59.411	Alphabet Inc. - A	6.162.703	4,85	6.489	Lincoln National Corp.	145.808	0,11
38.481	Altria Group Inc.	1.717.022	1,35	4.912	Lockheed Martin Corp.	2.322.050	1,83
17.163	Amazon.com Inc.	1.772.766	1,39	12.518	Marathon Petroleum Corp.	1.687.802	1,33
22.279	American Electric Power Company Inc.	2.027.166	1,60	13.635	Marsh & McLennan Companies Inc.	2.270.910	1,79
446	Amgen Inc.	107.821	0,08	6.944	Masco Corp.	345.256	0,27
58.304	Apple Inc.	9.614.329	7,56	8.490	Mastercard Inc. - A	3.085.351	2,43
23.244	Archer-Daniels-Midland Company	1.851.617	1,46	2.792	McKesson Corp.	994.092	0,78
3.444	Autodesk Inc.	716.903	0,56	14.277	Meta Platforms Inc.	3.025.867	2,39
3.625	Automatic Data Processing Inc.	807.034	0,63	24.748	Metlife Inc.	1.433.899	1,13
656	Autozone Inc.	1.612.546	1,27	30.774	Microsoft Corp.	8.872.144	6,99
7.536	Bath & Body Works Inc.	275.667	0,22	26.901	Morgan Stanley	2.361.907	1,85
4.204	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	408.797	0,32	18.004	Mosaic Company	826.023	0,65
36.853	Bristol-Myers Squibb Company	2.554.280	2,01	10.556	Nucor Corp.	1.630.585	1,28
13.341	Cardinal Health Inc.	1.007.246	0,79	2.739	NVIDIA Corp.	760.812	0,60
2.375	Caterpillar Inc.	543.495	0,43	2.308	O'Reilly Automotive Inc.	1.959.447	1,53
5.061	Centene Corp.	319.906	0,25	5.305	Parker Hannifin Corp.	1.783.063	1,40
5.206	CF Industries Holdings Inc.	377.383	0,30	62.316	Pfizer Inc.	2.542.493	2,00
3.068	Cintas Corp.	1.419.502	1,12	10.176	Philip Morris International Inc.	989.616	0,78
54.623	Cisco Systems Inc.	2.855.417	2,25	3.710	Procter & Gamble Company	551.640	0,43
26.255	Citigroup Inc.	1.231.097	0,97	21.286	PulteGroup Inc.	1.240.548	0,98
2.210	CME Group Inc.	423.259	0,33	20.341	QUALCOMM Inc.	2.595.105	2,04
11.166	CSX Corp.	334.310	0,26	754	Regeneron Pharmaceuticals Inc.	619.539	0,49
13.968	CVS Health Corp.	1.037.962	0,82	15.620	Regions Financial Corp.	289.907	0,23
3.045	Delta Air Lines Inc.	106.331	0,09	3.028	SBA Communications Corp.	790.520	0,62
6.117	Electronic Arts Inc.	736.793	0,58	2.853	Southwest Airlines Company	92.837	0,07
4.222	EQT Corp.	134.724	0,11	27.024	State Street Corp.	2.045.447	1,61
8.193	Etsy Inc.	912.127	0,72	13.084	Synchrony Financial	380.483	0,30
17.108	Evergy Inc.	1.045.641	0,82	4.864	Tesla Inc.	1.009.085	0,79
16.917	Expedia Group Inc.	1.641.457	1,29	16.184	Textron Inc.	1.143.076	0,90
25.243	Exxon Mobil Corp.	2.768.148	2,17	2.905	Ulta Beauty Inc.	1.585.171	1,25
38.039	Fortinet Inc.	2.528.072	1,99	5.091	United Parcel Service Inc.	987.603	0,78
7.361	Fortive Corp.	501.799	0,39	13.832	Valero Energy Corp.	1.930.947	1,52
20.110	Fox Corp.	684.746	0,54	2.672	Vertex Pharmaceuticals Inc.	841.867	0,67
14.287	General Mills Inc.	1.220.967	0,96	20.483	Viatis Inc.	197.046	0,16
				55.955	Wells Fargo & Company	2.091.598	1,65

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
54.711	Weyerhaeuser Company	1.648.442	1,30
	Vereinigte Staaten, insgesamt	125.346.974	98,62
	Aktien, insgesamt	125.538.670	98,77
	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	125.538.670	98,77
	Wert der Anlagen, insgesamt	125.538.670	98,77
	(Gesamtkosten: USD 121.462.832)		

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BELGIEN				ITALIEN			
65.217	KBC Group NV	4.128.236	0,95	95.844	Moncler SpA	6.089.928	1,40
	Belgien, insgesamt	4.128.236	0,95		Italien, insgesamt	6.089.928	1,40
DÄNEMARK				NIEDERLANDE			
25.662	DSV A/S	4.569.646	1,05	3.064	Adyen NV	4.470.989	1,03
144.741	Novo Nordisk AS	21.097.267	4,84	13.710	ASML International NV	5.098.749	1,17
	Dänemark, insgesamt	25.666.913	5,89	25.882	ASML Holding NV	16.181.426	3,72
				586.548	ING Groep NV	6.410.970	1,47
				40.697	Koninklijke DSM NV	4.423.764	1,02
				96.326	STMicroelectronics NV	4.715.158	1,08
					Niederlande, insgesamt	41.301.056	9,49
FRANKREICH				NORWEGEN			
53.739	Air Liquide SA	8.286.554	1,89	319.976	DNB Bank ASA	5.268.505	1,21
343.575	AXA SA	9.676.790	2,22		Norwegen, insgesamt	5.268.505	1,21
128.351	BNP Paribas SA	7.086.259	1,62				
111.793	Compagnie de Saint-Gobain	5.849.010	1,34				
38.023	EssilorLuxottica SA	6.311.818	1,45				
4.194	Hermes International	7.817.616	1,80				
36.148	L'Oreal SA	14.865.865	3,41				
22.515	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	19.011.666	4,36				
51.710	Pernod-Ricard SA	10.791.877	2,48				
99.521	Publicis Groupe SA	7.143.617	1,64				
46.147	Schneider Electric SE	7.091.871	1,63				
18.924	Teleperformance	4.195.451	0,96				
275.943	TotalEnergies SE	15.000.261	3,44				
40.784	Vinci SA	4.311.684	0,99				
	Frankreich, insgesamt	127.440.339	29,23				
DEUTSCHLAND				SCHWEDEN			
62.806	Brenntag SE	4.346.175	1,00	352.766	Atlas Copco AB	4.118.831	0,95
138.052	Daimler Truck Holding AG	4.294.798	0,99	417.493	Sandvik AB	8.145.286	1,87
66.654	Dr Ing hc F Porsche AG	7.865.172	1,80		Schweden, insgesamt	12.264.117	2,82
66.221	Mercedes-Benz Group AG - Reg	4.687.122	1,08				
19.869	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG - Reg	6.407.753	1,47				
	Deutschland, insgesamt	27.601.020	6,34				
IRLAND				SCHWEIZ			
670.756	Bank of Ireland Group plc	6.254.129	1,44	73.743	Compagnie Financiere Richemont SA - Reg	10.840.120	2,49
198.328	CRH plc	9.217.294	2,12	11.822	Lonza Group AG - Reg	6.520.092	1,50
124.165	Experian plc	3.758.786	0,86	128.590	Nestle SA - Reg	14.440.566	3,32
70.337	Kingspan Group plc	4.434.044	1,02	55.593	Roche Holding AG	14.616.231	3,36
	Irland, insgesamt	23.664.253	5,44	28.315	Sika AG	7.288.958	1,67
				359.341	UBS Group AG	6.983.884	1,60
					Schweiz, insgesamt	60.689.851	13,94
				VEREINIGTES KÖNIGREICH			
				667.317	3i Group plc	12.796.727	2,95
				190.368	Ashtead Group plc	10.741.559	2,47
				116.049	Astrazeneca plc	14.834.241	3,41
				363.364	Compass Group plc	8.407.098	1,93
				530.676	Howden Joinery Group plc	4.215.525	0,97
				37.154	London Stock Exchange Group plc	3.326.877	0,76
				125.317	Reckitt Benckiser Group plc	8.782.466	2,02
				1.060.943	Rentokil Initial plc	7.143.105	1,64
				90.799	Rio Tinto plc	5.660.697	1,30
				483.603	SSE plc	9.923.195	2,28

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)			
451.841	St James's Place plc	6.227.254	1,43
	Vereinigtes Königreich, insgesamt	92.058.744	21,16
	Aktien, insgesamt	426.172.962	97,87
	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	426.172.962	97,87

Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren

Fonds

IRLAND

71.065	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	7.024.720	1,61
	Irland, insgesamt	7.024.720	1,61
	Fonds, insgesamt	7.024.720	1,61
	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt	7.024.720	1,61
	Wert der Anlagen, insgesamt	433.197.682	99,48
	(Gesamtkosten: EUR 365.924.793)		

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BELGIEN				ITALIEN (Fortsetzung)			
27.229	KBC Group NV	1.723.596	2,48	206.146	Nexi SpA	1.543.209	2,22
6.477	Melexis NV	689.153	0,99		Italien, insgesamt	3.828.367	5,50
	Belgien, insgesamt	2.412.749	3,47				
DÄNEMARK				JERSEY - KANALINSELN			
51.629	Tryg A/S	1.038.915	1,50	162.913	WPP plc	1.777.297	2,56
	Dänemark, insgesamt	1.038.915	1,50		Jersey - Kanalinseln, insgesamt	1.777.297	2,56
FINNLAND				NIEDERLANDE			
19.383	Upm-Kymmene Oyj	599.904	0,86	5.190	ASM International NV	1.930.161	2,78
	Finnland, insgesamt	599.904	0,86	24.841	BE Semiconductor Industries NV	1.989.764	2,86
				390.793	Royal KPN NV	1.272.422	1,83
FRANKREICH				Niederlande, insgesamt			
11.196	Air Liquide SA	1.726.423	2,49		5.192.347	7,47	
86.603	AXA SA	2.439.175	3,52	SPANIEN			
30.801	BNP Paribas SA	1.700.523	2,45	129.173	Iberdrola SA	1.483.552	2,14
21.995	Compagnie de Saint-Gobain	1.150.778	1,66	65.410	Inditex SA	2.021.169	2,91
1.905	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	1.608.582	2,31		Spanien, insgesamt	3.504.721	5,05
8.483	Pernod-Ricard SA	1.770.402	2,55	SCHWEDEN			
6.863	Sanofi	687.947	0,99	66.546	Sandvik AB	1.298.312	1,87
11.113	Schneider Electric SE	1.707.846	2,46		Schweden, insgesamt	1.298.312	1,87
41.680	TotalEnergies SE	2.265.725	3,26	SCHWEIZ			
19.706	Vinci SA	2.083.318	3,00	14.069	Nestle SA - Reg	1.579.939	2,27
	Frankreich, insgesamt	17.140.719	24,69	1.306	Partners Group Holding AG - Reg	1.127.407	1,62
DEUTSCHLAND				7.080	Roche Holding AG	1.861.438	2,68
24.633	Brenntag SE	1.704.604	2,45		Schweiz, insgesamt	4.568.784	6,57
38.275	Daimler Truck Holding AG	1.190.735	1,71	VEREINIGTES KÖNIGREICH			
59.735	Deutsche Telekom AG - Reg	1.335.077	1,92	99.464	3i Group plc	1.907.359	2,75
12.737	Mercedes-Benz Group AG - Reg	901.525	1,30	224.011	Allfunds Group plc	1.361.987	1,96
14.024	SAP SE	1.627.625	2,34	32.499	Anglo American plc	990.484	1,43
14.606	Siemens AG - Reg	2.180.092	3,14	15.573	Astrazeneca plc	1.990.656	2,86
23.161	Siemens Healthineers AG	1.227.996	1,77	12.199	London Stock Exchange Group plc	1.092.334	1,57
	Deutschland, insgesamt	10.167.654	14,63	56.140	Persimmon plc	802.470	1,15
IRLAND				19.099	Reckitt Benckiser Group plc	1.338.496	1,93
152.998	Bank of Ireland Group plc	1.426.553	2,05	69.397	SSE plc	1.423.978	2,05
44.787	CRH plc	2.081.476	2,99	131.777	St James's Place plc	1.816.145	2,61
	Irland, insgesamt	3.508.029	5,04				
ITALIEN							
406.106	Enel SpA	2.285.158	3,28				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)			
1.100.499	Vodafone Group plc	1.118.428	1,61
	Vereinigtes Königreich, insgesamt	13.842.337	19,92
	Aktien, insgesamt	68.880.135	99,13
	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	68.880.135	99,13
	Wert der Anlagen, insgesamt	68.880.135	99,13
	(Gesamtkosten: EUR 63.774.985)		

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BELGIEN				IRLAND (Fortsetzung)			
131.576	Azelis Group NV	3.073.615	0,78	680.437	Dalata Hotel Group Limited	2.851.031	0,73
310	Lotus Bakeries NV	1.999.500	0,51	816.790	Irish Continental Group plc	3.565.288	0,91
94.065	Melexis NV	10.008.516	2,55		Irland, insgesamt	10.602.798	2,71
	Belgien, insgesamt	15.081.631	3,84				
DÄNEMARK				INSEL MAN			
130.763	ALK-Abello AS	1.862.452	0,48	2.333.609	Strix Group plc	2.650.486	0,68
77.665	Simcorp A/S	5.408.914	1,38		Insel Man, insgesamt	2.650.486	0,68
	Dänemark, insgesamt	7.271.366	1,86				
FINNLAND				ITALIEN			
166.527	Huhtamaki Oyj	5.695.223	1,45	379.682	Carel Industries SpA	9.567.986	2,44
114.086	Musti Group Oyj	1.837.925	0,47	20.815	Diasorin SpA	2.020.304	0,52
67.452	Revenio Group Oyj	2.606.345	0,67	243.561	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	2.951.959	0,75
112.485	Vaisala Oyj	4.471.279	1,14	112.226	Interpump Group SpA	5.796.473	1,48
	Finnland, insgesamt	14.610.772	3,73	170.544	MARR SpA	2.258.003	0,58
				405.117	Technoprobe SpA	2.701.320	0,69
					Italien, insgesamt	25.296.045	6,46
FRANKREICH				JERSEY - KANALINSELN			
214.777	Elis SA	3.788.666	0,97	1.010.259	JTC plc	8.082.670	2,05
20.196	Gaztransport et Technigaz SA	1.902.463	0,49		Jersey - Kanalinseln, insgesamt	8.082.670	2,05
235.576	Lectra	8.563.187	2,18				
11.914	Remy Cointreau SA	2.001.552	0,51				
242.485	Verallia SA	9.529.661	2,44				
6.135	Virbac SA	1.815.960	0,46				
	Frankreich, insgesamt	27.601.489	7,05				
DEUTSCHLAND				NIEDERLANDE			
169.969	CANCOM SE	5.354.024	1,37	65.510	BE Semiconductor Industries NV	5.247.351	1,34
170.028	CompuGroup Medical SE & Company KgaA	8.055.926	2,06	27.874	IMCD NV	4.192.249	1,07
156.562	CTS Eventim AG & Company KGaA	8.994.486	2,29		Niederlande, insgesamt	9.439.600	2,41
38.200	Gerresheimer AG	3.481.930	0,89				
75.257	Nemetschek SE	4.762.263	1,22				
109.253	Stabilus SE	7.035.893	1,80				
51.064	STRATEC SE	3.196.606	0,82				
	Deutschland, insgesamt	40.881.128	10,45				
ISLAND				SPANIEN			
1.338.292	Marel HF	5.031.978	1,28	406.822	Fluidra SA	6.586.448	1,68
	Island, insgesamt	5.031.978	1,28	37.494	Viscofan SA	2.474.604	0,63
IRLAND				SCHWEDEN			
1.118.781	AIB Group plc	4.186.479	1,07	370.024	Avanza Bank Holding AB	7.981.153	2,04
				527.436	Elekta AB - B	3.702.251	0,95
				376.391	Engcon AB	2.629.320	0,67
				851.083	Fortnox AB	5.357.598	1,37
				290.419	Hexpol AB	3.312.513	0,85
				1.582.406	Karnov Group AB	7.598.794	1,94
				134.909	MIPS AB	6.270.036	1,60
				1.031.556	Munters Group AB	8.748.890	2,23
				229.814	Nordnet AB publ	3.483.106	0,89

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
SCHWEDEN (Fortsetzung)				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)			
190.972	Thule Group AB	4.317.458	1,10	864.703	Watches of Switzerland Group plc	8.025.235	2,05
	Schweden, insgesamt	53.401.119	13,64		Vereinigtes Königreich, insgesamt	114.480.060	29,22
SCHWEIZ				Aktien, insgesamt			
17.655	Belimo Holding AG	7.844.483	2,00	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt			
4.034	Inficon Holding AG	4.011.539	1,02	389.105.544			
2.842	LEM Holding SA	5.629.445	1,45	99,33			
426.345	SIG Group AG	10.103.143	2,58	Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
11.375	Tecan Group AG - Reg	4.575.093	1,16	Aktien			
18.945	VAT Group AG	6.264.569	1,60	DÄNEMARK			
95.212	VZ Holding AG	7.185.078	1,83	49.761	Ow Bunker A/S**	0	0,00
	Schweiz, insgesamt	45.613.350	11,64		Dänemark, insgesamt	0	0,00
VEREINIGTES KÖNIGREICH				Aktien, insgesamt			
211.317	Abcam plc	2.618.001	0,67	0			
651.180	Allfunds Group plc	3.959.174	1,01	0,00			
1.793.953	Ascential plc	4.920.338	1,26	Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt			
440.323	Auction Technology Group plc	3.076.852	0,79	0			
484.480	Big Yellow Group plc	6.445.508	1,65	0,00			
430.504	Cvs Group plc	9.088.410	2,32	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
1.741.785	Dr. Martens plc	2.820.761	0,72	Fonds			
173.004	FD Technologies plc	3.366.814	0,86	IRLAND			
309.944	Future plc	4.088.213	1,04	2.621	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	259.128	0,07
31.644	Games Workshop Group plc	3.471.644	0,89		Irland, insgesamt	259.128	0,07
237.472	Genus plc	7.767.227	1,98	Fonds, insgesamt			
480.124	GlobalData plc	6.666.226	1,70	259.128			
1.035.438	Howden Joinery Group plc	8.225.198	2,10	0,07			
1.401.145	Ibstock plc	2.750.673	0,70	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt			
125.231	Intermediate Capital Group plc	1.734.480	0,44	259.128			
4.800.426	Johnson Service Group plc	6.686.949	1,71	0,07			
108.817	Keywords Studios plc	3.415.528	0,87	Wert der Anlagen, insgesamt			
906.770	Moonpig Group plc	1.273.442	0,33	389.364.672			
61.660	Renishaw plc	2.872.885	0,73	99,40			
605.064	Rightmove plc	3.876.827	0,98	(Gesamtkosten: EUR 349.754.549)			
512.177	RWS Holdings plc	1.742.842	0,44	<i>*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.</i>			
310.263	St James's Place plc	4.276.032	1,09	<i>**Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.</i>			
1.145.425	Synthomer plc	1.521.263	0,39				
603.957	Victoria plc	3.367.975	0,86				
99.498	Victrex plc	1.803.836	0,46				
942.515	Volution Group plc	4.617.727	1,18				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BELGIEN				ISLAND			
261.718	Azelis Group NV	6.113.733	0,82	2.567.671	Marel HF	9.654.443	1,29
571	Lotus Bakeries NV	3.682.950	0,49		Island, insgesamt	9.654.443	1,29
96.570	Melexis NV	10.275.048	1,38				
	Belgien, insgesamt	20.071.731	2,69				
DÄNEMARK				IRLAND			
303.203	ALK-Abello AS	4.318.507	0,58	2.069.705	AIB Group plc	7.744.836	1,04
152.604	Simcorp A/S	10.627.978	1,42	1.941.851	Dalata Hotel Group Limited	8.136.356	1,09
382.153	Tryg A/S	7.689.953	1,03	1.424.908	Irish Continental Group plc	6.219.723	0,84
	Dänemark, insgesamt	22.636.438	3,03		Irland, insgesamt	22.100.915	2,97
FINNLAND				ITALIEN			
82.000	Cargotec Oyj	3.671.960	0,49	72.998	Diasorin SpA	7.085.186	0,95
333.698	Huhtamaki Oyj	11.412.472	1,53	1.019.423	Fincobank Banca Fineco SpA	14.414.641	1,93
241.944	Musti Group Oyj	3.897.718	0,52	1.273.881	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	15.439.438	2,07
131.285	Revenio Group Oyj	5.072.852	0,68	209.136	Interpump Group SpA	10.801.874	1,45
	Finnland, insgesamt	24.055.002	3,22	324.056	MARR SpA	4.290.501	0,57
FRANKREICH				JERSEY - KANALINSELN			
334.492	Bureau Veritas SA	8.854.003	1,19	627.754	JTC plc	5.022.404	0,67
121.406	Edenred	6.621.483	0,89		Jersey - Kanalinseln, insgesamt	5.022.404	0,67
786.894	Elis SA	13.880.811	1,85				
37.534	Gaztransport et Technigaz SA	3.535.703	0,47				
44.124	Remy Cointreau SA	7.412.832	0,99				
45.171	SEB SA	4.733.921	0,63				
109.073	Ubisoft Entertainment SA	2.667.926	0,36				
477.570	Verallia SA	18.768.501	2,51				
13.215	Virbac SA	3.911.640	0,52				
	Frankreich, insgesamt	70.386.820	9,41				
DEUTSCHLAND				LUXEMBURG			
380.757	CANCOM SE	11.993.846	1,61	219.115	Eurofins Scientific SE	13.506.249	1,81
56.164	Carl Zeiss Meditec AG	7.188.992	0,96		Luxemburg, insgesamt	13.506.249	1,81
319.897	CompuGroup Medical SE & Company KgaA	15.156.720	2,04				
296.380	CTS Eventim AG & Company KGaA	17.027.031	2,28				
88.163	Gerresheimer AG	8.036.057	1,08				
107.649	Nemetschek SE	6.812.029	0,91				
126.203	Puma SE	7.175.903	0,96				
166.956	Stabilus SE	10.751.966	1,44				
100.000	STRATEC SE	6.260.000	0,84				
285.092	TeamViewer AG	4.463.115	0,60				
	Deutschland, insgesamt	94.865.659	12,72				
				NIEDERLANDE			
				47.954	ASM International NV	17.834.093	2,38
				125.623	BE Semiconductor Industries NV	10.062.402	1,35
				575.806	Davide Campari-Milano NV	6.477.818	0,87
				45.945	IMCD NV	6.910.128	0,93
					Niederlande, insgesamt	41.284.441	5,53
				SPANIEN			
				807.190	Fluidra SA	13.068.406	1,75
				69.937	Viscofan SA	4.615.842	0,62
					Spanien, insgesamt	17.684.248	2,37
				SCHWEDEN			
				707.996	Avanza Bank Holding AB	15.270.966	2,06

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
SCHWEDEN (Fortsetzung)				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)			
1.098.143	Elekta AB - B	7.708.236	1,03	1.609.897	Watches of Switzerland Group plc	14.941.316	2,00
1.931.229	Fortnox AB	12.157.155	1,63				
592.500	Hexpol AB	6.758.043	0,91		Vereinigtes Königreich, insgesamt	209.684.411	28,08
101.132	MIPS AB	4.700.215	0,63				
435.249	Nordnet AB publ	6.596.718	0,88		Aktien, insgesamt	740.586.909	99,21
366.590	Thule Group AB	8.287.795	1,11				
	Schweden, insgesamt	61.479.128	8,25		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	740.586.909	99,21
SCHWEIZ				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
33.323	Belimo Holding AG	14.806.100	1,98	Fonds			
8.039	Inficon Holding AG	7.994.240	1,07	IRLAND			
812.894	SIG Group AG	19.263.236	2,58	25.474	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	2.518.125	0,34
23.651	Tecan Group AG - Reg	9.512.574	1,28		Irland, insgesamt	2.518.125	0,34
37.471	VAT Group AG	12.390.586	1,66				
	Schweiz, insgesamt	63.966.736	8,57		Fonds, insgesamt	2.518.125	0,34
VEREINIGTES KÖNIGREICH				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt			
457.833	Abcam plc	5.672.081	0,76			2.518.125	0,34
1.226.449	Allfunds Group plc	7.456.810	1,00		Wert der Anlagen, insgesamt	743.105.034	99,55
3.719.060	Ascential plc	10.200.396	1,37				
854.007	Auction Technology Group plc	5.967.557	0,81		(Gesamtkosten: EUR 735.954.012)		
1.009.163	Big Yellow Group plc	13.425.876	1,80				
827.092	Cvs Group plc	17.460.817	2,34				
3.338.856	Dr. Martens plc	5.407.162	0,72				
2.944.960	Elementis plc	3.991.701	0,53				
300.975	FD Technologies plc	5.857.244	0,78				
650.639	Future plc	8.582.036	1,15				
59.642	Games Workshop Group plc	6.543.288	0,88				
441.534	Genus plc	14.441.680	1,93				
611.764	GlobalData plc	8.493.967	1,14				
1.973.607	Howden Joinery Group plc	15.677.720	2,10				
2.694.398	Ibstock plc	5.289.537	0,71				
233.588	Intermediate Capital Group plc	3.235.251	0,43				
113.834	Keywords Studios plc	3.573.000	0,48				
1.774.903	Moonpig Group plc	2.492.623	0,33				
210.486	Renishaw plc	9.807.038	1,31				
842.977	Rentokil Initial plc	5.675.586	0,76				
622.736	Rightmove plc	3.990.058	0,53				
990.445	RWS Holdings plc	3.370.299	0,45				
1.087.708	St James's Place plc	14.990.747	2,01				
1.573.955	Synthomer plc	2.090.403	0,28				
913.925	Victoria plc	5.096.517	0,68				
328.401	Victrex plc	5.953.701	0,80				

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Select

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
DÄNEMARK				NORWEGEN			
178.285	DSV A/S	31.747.303	2,07	1.697.015	DNB Bank ASA	27.941.884	1,82
356.109	Novo Nordisk AS	51.906.001	3,39		Norwegen, insgesamt	27.941.884	1,82
2.044.278	Tryg A/S	41.136.408	2,68				
	Dänemark, insgesamt	124.789.712	8,14	SPANIEN			
FRANKREICH				808.940	Amadeus IT Holding SA - A	49.879.241	3,26
180.756	Air Liquide SA	27.872.575	1,82	2.201.075	Inditex SA	68.013.217	4,44
204.189	Dassault Systemes SE	7.733.658	0,50		Spanien, insgesamt	117.892.458	7,70
26.472	Hermes International	49.343.808	3,22	SCHWEDEN			
363.057	Legrand SA	30.525.833	1,99	3.530.396	Atlas Copco AB	41.220.258	2,69
99.821	L'Oreal SA	41.051.386	2,68	2.090.329	Sandvik AB	40.782.306	2,66
86.686	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	73.197.658	4,78		Schweden, insgesamt	82.002.564	5,35
238.386	Pernod-Ricard SA	49.751.158	3,24	SCHWEIZ			
486.897	Schneider Electric SE	74.826.331	4,89	111.363	Lonza Group AG - Reg	61.419.138	4,01
	Frankreich, insgesamt	354.302.407	23,12	884.567	Nestle SA - Reg	99.336.252	6,48
DEUTSCHLAND				17.091	Partners Group Holding AG - Reg	14.753.835	0,96
681.022	Brenntag SE	47.126.722	3,08	105.370	Roche Holding AG	27.703.349	1,81
228.494	Hannover Rueck SE - Reg	41.208.892	2,69	113.054	Sika AG	29.102.804	1,90
87.305	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG - Reg	28.155.863	1,84	83.978	VAT Group AG	27.769.119	1,81
457.154	SAP SE	53.057.293	3,47		Schweiz, insgesamt	260.084.497	16,97
339.077	Siemens Healthineers AG	17.977.863	1,17	VEREINIGTES KÖNIGREICH			
540.866	Zalando SE	20.844.976	1,36	2.596.632	Allfunds Group plc	15.787.522	1,04
	Deutschland, insgesamt	208.371.609	13,61		Vereinigtes Königreich, insgesamt	15.787.522	1,04
ITALIEN				Aktien, insgesamt			
2.516.341	Fincobank Banca Fineco SpA	35.581.062	2,33	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt			
1.746.641	Nexi SpA	13.075.355	0,85	1.505.974.526			
	Italien, insgesamt	48.656.417	3,18	98,30			
NIEDERLANDE				1.505.974.526			
6.342	Adyen NV	9.254.246	0,60	98,30			
71.576	ASM International NV	26.619.114	1,74				
137.341	ASML Holding NV	85.865.594	5,60				
4.135.926	Davide Campari-Milano NV	46.529.168	3,04				
270.157	IMCD NV	40.631.613	2,65				
188.305	Koninklijke DSM NV	20.468.754	1,34				
751.317	STMicroelectronics NV	36.776.967	2,40				
	Niederlande, insgesamt	266.145.456	17,37				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Select

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Fonds			
IRLAND			
268.997	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	26.590.262	1,74
10.204	ILF EUR Liquidity Fund	991.817	0,06
	Irland, insgesamt	27.582.079	1,80
	Fonds, insgesamt	27.582.079	1,80
	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt	27.582.079	1,80
	Wert der Anlagen, insgesamt	1.533.556.605	100,10

(Gesamtkosten: EUR 1.238.142.720)

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BELGIEN				DEUTSCHLAND (Fortsetzung)			
898.717	Azelis Group NV	20.994.029	1,45	324.573	Stabilus SE	20.902.501	1,45
2.449	Lotus Bakeries NV	15.796.050	1,09	226.925	STRATEC SE	14.205.505	0,98
345.221	Melexis NV	36.731.514	2,54		Deutschland, insgesamt	243.115.535	16,82
365.673	Umicore SA	11.412.654	0,79				
	Belgien, insgesamt	84.934.247	5,87				
DÄNEMARK				ISLAND			
988.925	ALK-Abello AS	14.085.216	0,97	4.986.949	Marel HF	18.750.928	1,30
286.655	Simcorp A/S	19.963.849	1,38		Island, insgesamt	18.750.928	1,30
1.458.911	Tryg A/S	29.357.239	2,03				
	Dänemark, insgesamt	63.406.304	4,38	IRLAND			
FINNLAND				3.948.632	AIB Group plc	14.775.781	1,02
227.331	Cargotec Oyj	10.179.882	0,70	2.948.273	Dalata Hotel Group Limited	12.353.264	0,86
706.564	Huhtamaki Oyj	24.164.489	1,67	2.725.080	Irish Continental Group plc	11.894.974	0,83
578.834	Konecranes Oyj	17.851.241	1,24	234.563	Kingspan Group plc	14.786.852	1,02
448.364	Musti Group Oyj	7.223.144	0,50		Irland, insgesamt	53.810.871	3,73
218.963	Revenio Group Oyj	8.460.730	0,59	ITALIEN			
460.475	Vaisala Oyj	18.303.881	1,27	140.219	Diasorin SpA	13.609.656	0,94
	Finnland, insgesamt	86.183.367	5,97	2.301.428	Fincobank Banca Fineco SpA	32.542.192	2,25
FRANKREICH				2.629.360	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	31.867.843	2,21
1.291.970	Bureau Veritas SA	34.198.447	2,37	547.678	Intercos SpA	7.289.594	0,50
323.447	Edenred	17.640.799	1,22	403.022	Interpump Group SpA	20.816.086	1,44
1.475.565	Elis SA	26.028.967	1,80	617.980	MARR SpA	8.182.055	0,57
71.507	Gaztransport et Technigaz SA	6.735.959	0,47	1.444.177	Nexi SpA	10.811.109	0,75
144.080	Remy Cointreau SA	24.205.440	1,68	1.457.144	Technoprobe SpA	9.716.236	0,67
109.910	SEB SA	11.518.568	0,80		Italien, insgesamt	134.834.771	9,33
934.608	Verallia SA	36.730.094	2,55	LUXEMBURG			
	Frankreich, insgesamt	157.058.274	10,89	372.636	Eurofins Scientific SE	22.969.283	1,59
DEUTSCHLAND					Luxemburg, insgesamt	22.969.283	1,59
52.201	Atoss Software AG	8.696.687	0,60	NIEDERLANDE			
327.720	Brenntag SE	22.678.224	1,57	113.692	ASM International NV	42.282.055	2,93
536.325	CANCOM SE	16.894.238	1,17	221.688	BE Semiconductor Industries NV	17.757.209	1,23
124.273	Carl Zeiss Meditec AG	15.906.944	1,10	2.558.881	Davide Campari-Milano NV	28.787.411	1,99
571.164	CompuGroup Medical SE & Company KGaA	27.061.750	1,87	247.997	IMCD NV	37.298.749	2,58
612.086	CTS Eventim AG & Company KGaA	35.164.341	2,43		Niederlande, insgesamt	126.125.424	8,73
165.174	Gerresheimer AG	15.055.610	1,04	SPANIEN			
352.369	Nemetschek SE	22.297.910	1,55	1.445.765	Fluidra SA	23.406.935	1,62
257.530	Puma SE	14.643.156	1,01	134.147	Viscofan SA	8.853.702	0,61
16.643	Rational AG	10.268.731	0,71		Spanien, insgesamt	32.260.637	2,23
49.974	Sartorius AG	19.339.938	1,34				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Aktien (Fortsetzung)				Fonds			
SCHWEDEN				IRLAND			
1.339.050	Avanza Bank Holding AB	28.882.349	2,00	177.747	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	17.570.241	1,22
2.189.646	Elekta AB - B	15.369.864	1,06		Irland, insgesamt	17.570.241	1,22
3.208.660	Fortnox AB	20.198.628	1,40		Fonds, insgesamt	17.570.241	1,22
776.668	Hemnet Group AB	12.036.746	0,83		Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt	17.570.241	1,22
989.485	Hexpol AB	11.286.045	0,78		Wert der Anlagen, insgesamt	1.435.047.467	99,34
228.687	MIPS AB	10.628.465	0,74		(Gesamtkosten: EUR 1.097.203.125)		
1.332.347	Nordnet AB publ	20.193.310	1,40				
603.290	Thule Group AB	13.639.062	0,94				
145.906	Vitrolife AB	2.787.051	0,19				
	Schweden, insgesamt	135.021.520	9,34				
SCHWEIZ				<i>*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.</i>			
				<i>**Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.</i>			
79.420	Belimo Holding AG	35.287.953	2,45				
54.690	Burckhardt Compression Holding AG	31.297.833	2,17				
18.744	Inficon Holding AG	18.639.636	1,29				
11.394	LEM Holding SA	22.569.282	1,55				
1.601.929	SIG Group AG	37.961.082	2,63				
112.193	Sika AG	28.881.162	2,00				
173.749	SKAN Group AG	14.652.299	1,02				
62.911	Tecan Group AG - Reg	25.303.181	1,76				
98.482	VAT Group AG	32.565.176	2,25				
	Schweiz, insgesamt	247.157.604	17,12				
VEREINIGTES KÖNIGREICH							
1.948.760	Allfunds Group plc	11.848.461	0,82				
	Vereinigtes Königreich, insgesamt	11.848.461	0,82				
	Aktien, insgesamt	1.417.477.226	98,12				
	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	1.417.477.226	98,12				
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente							
Aktien							
DÄNEMARK							
280.528	Ow Bunker A/S**	0	0,00				
	Dänemark, insgesamt	0	0,00				
	Aktien, insgesamt	0	0,00				
	Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt	0	0,00				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
AUSTRALIEN				HONGKONG (Fortsetzung)			
76.722	ANZ Group Holdings Limited	1.178.248	2,26	439.000	Xinyi Glass Holdings Limited	786.288	1,50
50.340	Coles Group Limited	607.548	1,16	Hongkong, insgesamt			
323.645	Deterra Royalties Limited	1.040.454	1,99	7.900.342			
108.000	Dexus	543.221	1,04	INDIEN			
9.036	Macquarie Group Limited	1.063.070	2,03	238.036	Embassy Office Parks REIT	904.176	1,73
18.290	Mineral Resources Limited	987.205	1,89	53.550	HDFC Bank Limited	1.048.777	2,01
201.725	Santos Limited	932.226	1,78	129.825	Hindalco Industries Limited	640.336	1,23
140.475	Transurban Group	1.336.921	2,56	80.528	Infosys Limited	1.399.198	2,68
Australien, insgesamt		7.688.893	14,71	307.410	Power Grid Corp. of India Limited	844.245	1,62
KAIMANINSELN				Indien, insgesamt			
193.000	China Mengniu Dairy Company Limited	791.671	1,52	4.836.732			
264.000	China Resources Land Limited	1.203.979	2,30	9,27			
25.900	JD.com Inc.	567.493	1,09	INDONESIEN			
51.585	NetEase Inc.	906.848	1,74	1.368.600	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	853.393	1,63
28.000	Parade Technologies Limited	965.584	1,85	3.639.378	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	1.148.019	2,20
Kaimaninseln, insgesamt		4.435.575	8,50	Indonesien, insgesamt			
CHINA				2.001.412			
3,83				MALAYSIA			
696.700	Baoshan Iron & Steel Company Limited - A	633.061	1,21	491.200	CIMB Group Holdings Bhd	591.110	1,13
2.184.000	China Construction Bank Corp.	1.416.127	2,70	Malaysia, insgesamt			
106.500	China Merchants Bank Company Limited - H	544.034	1,04	591.110			
160.142	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	679.066	1,30	PHILIPPINEN			
184.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	1.197.762	2,29	410.710	BDO Unibank Inc.	970.766	1,86
30.300	Wuliangye Yibin Company Limited - A	869.209	1,66	Philippinen, insgesamt			
China, insgesamt		5.339.259	10,20	970.766			
HONGKONG				1,86			
174.800				SÜDKOREA			
174.800	AIA Group Limited	1.840.417	3,52	16.621	Kia Corp.	1.034.148	1,98
299.000	BOC Hong Kong Holdings Limited	931.284	1,78	3.864	LG Chem Limited	921.593	1,76
158.000	Galaxy Entertainment Group Limited	1.055.685	2,02	54.035	Samsung Electronics Company Limited Pfd	2.237.197	4,28
744.000	Guangdong Investment Limited	761.063	1,46	24.559	SK Telecom Company Limited	911.167	1,74
24.322	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.078.848	2,07	Südkorea, insgesamt			
372.000	Lenovo Group Limited	402.804	0,77	5.104.105			
74.500	Sun Hung Kai Properties Limited	1.043.953	2,00	9,76			
74.500				SINGAPUR			
1.043.953				757.500	CapitaLand Integrated Commercial Trust	1.128.088	2,16
2,00				15.600	Jardine Cycle & Carriage Limited	367.017	0,70
151.700				151.700	Keppel Corp. Limited	642.376	1,23
44.500				44.500	United Overseas Bank Limited	996.066	1,91
1.043.953				Singapur, insgesamt			
2,00				3.133.547			
1.043.953				6,00			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
TAIWAN			
121.625	Chailease Holding Company Limited	892.777	1,71
146.000	Chroma ATE Inc.	851.126	1,63
94.000	Delta Electronics Inc.	929.260	1,78
233.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	4.078.740	7,81
120.000	Unimicron Technology Corp.	581.321	1,11
52.000	Yageo Corp.	903.446	1,73
	Taiwan, insgesamt	8.236.670	15,77
THAILAND			
1.144.600	Thai Beverage plc	542.362	1,04
322.063	Thai Oil plc	494.467	0,95
	Thailand, insgesamt	1.036.829	1,99
	Aktien, insgesamt	51.275.240	98,14
	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	51.275.240	98,14
	Wert der Anlagen, insgesamt	51.275.240	98,14
	(Gesamtkosten: USD 49.295.163)		

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
KAIMANINSELN				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
48.989	Globalfoundries Inc.	3.536.026	0,55	617.914	Dropbox Inc. - A	13.359.301	2,08
240.374	SMART Global Holdings Inc.	4.144.048	0,64	126.457	DXC Technology Company	3.232.241	0,50
	Kaimaninseln, insgesamt	7.680.074	1,19	260.103	Ebay Inc.	11.540.770	1,79
				379.313	Eiger Biopharmaceuticals Inc.	340.206	0,05
				52.679	F5 Inc.	7.674.804	1,19
				62.395	Fidelity National Information Services Inc.	3.389.920	0,53
				61.991	Fiserv Inc.	7.006.843	1,09
				195.669	Fortinet Inc.	13.004.162	2,02
				481.748	Gen Digital Inc.	8.266.796	1,29
				188.603	GoDaddy Inc.	14.658.225	2,28
				101.902	HireRight Holdings Corp.	1.081.180	0,17
				75.891	Lam Research Corp.	40.231.336	6,26
				115.587	Lumentum Holdings Lite US	6.242.854	0,97
				311.087	Marvell Technology Inc.	13.470.067	2,09
				59.023	Match Group Inc.	2.265.893	0,35
				128.981	Microchip Technology Inc.	10.806.028	1,68
				81.223	Microsoft Corp.	23.416.592	3,64
				32.108	National Instruments Corp.	1.682.780	0,26
				179.984	NetApp Inc.	11.491.978	1,79
				58.688	ON Semiconductor Corp.	4.831.196	0,75
				168.007	Oracle Corp.	15.611.210	2,43
				70.761	Palo Alto Networks Inc.	14.133.803	2,20
				93.042	Qorvo Inc.	9.450.276	1,47
				4.260	QUALCOMM Inc.	543.491	0,08
				128.953	Rambus Inc.	6.610.131	1,03
				21.890	Salesforce Inc.	4.373.184	0,68
				10.987	Skyworks Solutions Inc.	1.296.246	0,20
				32.613	Splunk Inc.	3.126.934	0,49
				156.604	Synaptics Inc.	17.406.535	2,71
				59.711	Synopsys Inc.	23.063.374	3,59
				42.022	Tenable Holdings Inc.	1.996.465	0,31
				219.287	Teradyne Inc.	23.575.545	3,67
				136.507	Thoughtworks Holding Inc.	1.004.692	0,16
				17.629	T-Mobile USA Inc.	2.553.384	0,40
				76.490	Visa Inc. - A	17.245.435	2,68
				42.733	VMware Inc. - A	5.335.215	0,83
				191.894	Western Digital Corp.	7.228.647	1,12
					Vereinigte Staaten, insgesamt	559.120.059	86,92
					Aktien, insgesamt	619.850.434	96,36
					Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	619.850.434	96,36
					Wert der Anlagen, insgesamt	619.850.434	96,36
					(Gesamtkosten: USD 505.613.589)		

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert GBP	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert GBP	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
GUERNSEY - KANALINSELN				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)			
3.451.163	Sherborne Investors Guernsey C Limited	1.811.861	0,75	187.189	Unilever plc	7.843.219	3,26
	Guernsey - Kanalinseln, insgesamt	1.811.861	0,75	111.180	Whitbread plc	3.320.947	1,38
				1.063.628	Wincanton plc	2.297.436	0,95
VEREINIGTES KÖNIGREICH				Vereinigtes Königreich, insgesamt			
						237.032.176	98,44
632.650	3i Group plc	10.660.153	4,43	Aktien, insgesamt			
110.603	Astrazeneca plc	12.422.929	5,15	238.844.037			
722.523	BAE Systems plc	7.099.511	2,95	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt			
4.558.314	BT Group plc	6.646.022	2,76	238.844.037			
5.336.559	Centrica plc	5.659.421	2,35	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
828.289	Chesnara plc	2.484.867	1,03	Fonds			
302.267	Compass Group plc	6.145.088	2,55	IRLAND			
2.475.424	Direct Line Insurance Group plc	3.403.708	1,41	1.055.454	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	1.055.454	0,44
1.168.669	DS Smith plc	3.675.464	1,53	Irland, insgesamt			
955.044	Elementis plc	1.137.457	0,47	1.055.454			
66.514	Ferguson plc	7.083.741	2,94	Fonds, insgesamt			
714.647	GSK plc	10.212.306	4,24	1.055.454			
969.400	Haleon plc	3.121.468	1,30	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt			
3.887.726	Hays plc	4.334.814	1,80	1.055.454			
223.780	Hikma Pharmaceuticals plc	3.748.315	1,56	Wert der Anlagen, insgesamt			
121.686	Hostmore plc	15.381	0,01	239.899.491			
271.010	IMI plc	4.157.293	1,73	99,63			
707.450	Imperial Brands plc	13.186.868	5,48	(Gesamtkosten: GBP 229.385.981)			
4.964.720	ITV plc	4.110.788	1,71	<i>*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.</i>			
194.613	Johnson Matthey plc	3.860.149	1,61				
2.460.165	Legal & General Group plc	5.877.334	2,44				
3.207.600	Marks & Spencer Group plc	5.356.692	2,22				
1.832.170	Melrose Industries plc	3.050.563	1,27				
552.429	Morgan Advanced Materials plc	1.563.374	0,65				
163.996	Morgan Sindall plc	2.771.532	1,15				
213.140	Oxford Instruments plc	5.339.157	2,22				
1.099.007	Pearson plc	9.280.015	3,85				
188.811	Pennon Group plc	1.650.208	0,69				
1.399.397	Phoenix Group Holdings plc	7.646.305	3,18				
1.333.040	Rank Group plc	974.452	0,40				
302.450	RELX plc	7.918.141	3,29				
2.299.439	Rentokil Initial plc	13.603.481	5,64				
1.691.034	RS Group plc	15.456.051	6,41				
417.653	Smith & Nephew plc	4.686.067	1,95				
377.113	Smiths Group plc	6.473.145	2,68				
182.555	SSE plc	3.291.467	1,37				
749.745	Tate & Lyle plc	5.882.499	2,45				
2.195.313	Tesco plc	5.832.947	2,42				
391.881	Travis Perkins plc	3.747.950	1,56				
40.597	Unbound Group plc	3.451	0,00				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
22.850	Liveperson Inc. 0.00%	100.769	0,51	1.408	Hess Corp.	186.335	0,95
	Vereinigte Staaten, insgesamt	100.769	0,51	3.703	Hilton Worldwide Holdings Inc.	521.642	2,66
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt							
		100.769	0,51	1.863	Hostess Brands Inc.	46.351	0,24
Aktien				580	Installed Building Products Inc.	66.137	0,34
KANADA				1.440	Intuitive Surgical Inc.	367.877	1,87
3.682	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	207.260	1,06	6.247	Kellogg Company	418.299	2,13
	Kanada, insgesamt	207.260	1,06	7.006	Kontoor Brands Inc.	339.020	1,73
KAIMANINSELN				1.576	Lam Research Corp.	835.469	4,25
6.247	Globalfoundries Inc.	450.908	2,30	59.433	Latham Group Inc.	169.978	0,87
	Kaimaninseln, insgesamt	450.908	2,30	10.425	Marvell Technology Inc.	451.403	2,30
CURAÇAO				6.010	Northern Trust Corp.	529.661	2,70
5.020	Schlumberger Limited	246.482	1,26	41.091	NOV Inc.	760.594	3,87
	Curacao, insgesamt	246.482	1,26	8.492	Nutanix Inc. - A	220.707	1,12
JERSEY - KANALINSELN				2.484	Planet Fitness Inc.	192.932	0,98
11.453	Clarivate plc	107.544	0,55	3.957	Procter & Gamble Company	588.366	3,00
	Jersey - Kanalinseln, insgesamt	107.544	0,55	5.300	Prologis Inc.	661.281	3,37
VEREINIGTE STAATEN				3.253	QUALCOMM Inc.	415.018	2,11
11.147	Advanced Micro Devices Inc.	1.092.517	5,56	8.719	REVOLUTION Medicines Inc.	188.854	0,96
27.087	AES Corp.	652.255	3,32	296	S&P Global Inc.	102.052	0,52
4.742	Alphabet Inc. - A	491.888	2,51	3.318	Salesforce Inc.	662.871	3,37
1.920	Applied Industrial Technologies Inc.	272.889	1,39	3.564	Schnitzer Steel Industries Inc.	110.840	0,56
11.700	Aris Water Solutions Inc.	91.143	0,46	75.149	Sharecare Inc.	106.712	0,54
3.400	Beacon Roofing Supply Inc.	200.090	1,02	1.428	Sherwin-Williams Company	320.972	1,64
1.783	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	173.379	0,88	1.045	Shift4 Payments Inc.	79.211	0,40
2.048	Catalent Inc.	134.574	0,69	3.248	Stanley Black & Decker Inc.	261.724	1,33
492	Cintas Corp.	227.638	1,15	7.590	State Street Corp.	574.488	2,93
2.037	Cirrus Logic Inc.	222.807	1,14	5.240	Teradata Corp.	211.067	1,08
3.082	Coca Cola Company	191.176	0,97	2.449	Teradyne Inc.	263.292	1,34
869	Conmed Corp.	90.254	0,46	3.340	TransUnion	207.548	1,06
2.955	Crowdstrike Holdings Inc. - A	405.603	2,07	2.419	Trimble Inc.	126.804	0,65
6.753	Darling International Inc.	394.375	2,01	20.385	Uber Technologies Inc.	646.205	3,29
7.175	Domo Inc.	101.813	0,52	1.080	United Parcel Service Inc.	209.509	1,07
3.925	Electronic Arts Inc.	472.766	2,41	1.229	Vertex Pharmaceuticals Inc.	387.221	1,98
2.078	Exact Sciences Corp.	140.909	0,72	2.462	Voya Financial Inc.	175.935	0,90
567	Goldman Sachs Group Inc.	185.471	0,94	1.609	Walt Disney Company	161.109	0,82
913	Herc Holdings Inc.	103.991	0,53	4.502	Westrock Company	137.176	0,70
				6.220	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	291.594	1,48
				2.954	Xponential Fitness Inc.	89.772	0,46
					Vereinigte Staaten, insgesamt	17.731.564	90,32
					Aktien, insgesamt	18.743.758	95,49
					Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	18.844.527	96,00

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Fonds			
IRLAND			
3.647	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.647	0,02
	Irland, insgesamt	3.647	0,02
	Fonds, insgesamt	3.647	0,02
	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt	3.647	0,02
	Wert der Anlagen, insgesamt	18.848.174	96,02
	(Gesamtkosten: USD 18.253.926)		

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
AUSTRALIEN				FRANKREICH (Fortsetzung)					
EUR	1.648.000	APA Infrastructure Limited 1.25% 15/03/2033	1.215.101	0,28	EUR	3.793.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	3.662.454	0,84
EUR	1.098.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	837.712	0,20	EUR	3.318.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	3.286.648	0,77
EUR	1.100.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	839.238	0,20	Frankreich, insgesamt				
EUR	2.120.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd 0.63% 25/08/2030	1.686.214	0,39	18.624.644 4,33				
EUR	1.307.000	NBN Company Limited 4.38% 15/03/2033	1.354.640	0,32	DEUTSCHLAND				
USD	1.950.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	1.732.879	0,40	EUR	4.200.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	3.471.838	0,81
Australien, insgesamt				1,79	EUR	1.500.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	1.108.698	0,26
BELGIEN					EUR	2.844.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	2.632.096	0,62
EUR	6.700.000	Belfius Bank SA Perp FRN**	6.499.001	1,53	EUR	2.700.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	2.223.863	0,52
EUR	2.100.000	Elia Transmission Belgium SA 0.88% 28/04/2030	1.762.570	0,41	EUR	2.200.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	2.070.411	0,48
EUR	2.800.000	Kbc Group NV Perp FRN	2.366.969	0,55	EUR	2.200.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	1.736.641	0,41
Belgien, insgesamt				2,49	USD	1.752.000	Deutsche Bank AG FRN 10/02/2034	1.502.139	0,35
KAIMANINSELN					EUR	2.400.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	2.169.749	0,51
GBP	4.970.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	4.899.383	1,14	EUR	700.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	653.783	0,15
GBP	5.506.000	Thames Water Kemble Finance plc 2.88% 03/05/2027	5.432.914	1,27	EUR	1.100.000	Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	1.005.646	0,23
Kaimaninseln, insgesamt				2,41	EUR	1.081.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	1.023.273	0,24
DÄNEMARK					EUR	942.000	HT Troplast GmbH 9.25% 15/07/2025	934.994	0,22
EUR	575.000	Danske Bank AS FRN 15/05/2031	507.030	0,12	EUR	1.128.838	IHO Verwaltungs GmbH 8.75% 15/05/2028	1.157.591	0,27
USD	2.205.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	1.777.354	0,41	EUR	558.000	Ineos Styrolution Group GmbH 2.25% 16/01/2027	485.535	0,11
Dänemark, insgesamt				0,53	EUR	3.000.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	2.299.247	0,54
FRANKREICH					EUR	2.378.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	2.066.552	0,48
EUR	1.209.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	1.129.417	0,26	EUR	3.240.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	2.638.855	0,61
USD	3.500.000	BNP Paribas SA FRN 12/07/2171	2.521.211	0,59	EUR	1.300.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	1.193.293	0,28
EUR	2.600.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	1.872.351	0,44	EUR	2.288.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 2.00% 15/07/2025	2.137.114	0,50
EUR	800.000	Electricite de France SA FRN 06/12/2171	784.634	0,18	EUR	2.050.000	Thyssenkrupp AG 2.88% 22/02/2024	2.025.588	0,47
EUR	1.165.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	1.023.075	0,24	EUR	900.000	Vier Gas Transport GmbH 4.00% 26/09/2027	904.739	0,21
EUR	882.000	Faurecia SE 7.25% 15/06/2026	911.583	0,21	EUR	3.000.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	3.099.191	0,72
EUR	3.531.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	3.433.271	0,80					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
DEUTSCHLAND (Fortsetzung)				ITALIEN (Fortsetzung)					
EUR	2.700.000	Volkswagen Financial Services AG 0.88% 31/01/2028	2.320.015	0,54	EUR	100.000	Lottomatica SpA 5.13% 15/07/2025	98.832	0,02
EUR	500.000	Vonovia SE 5.00% 23/11/2030	468.940	0,11	EUR	362.000	Lottomatica SpA 6.25% 15/07/2025	361.779	0,09
		Deutschland, insgesamt	41.329.791	9,64	EUR	1.096.000	Lottomatica SpA 9.75% 30/09/2027	1.164.879	0,27
GIBRALTAR				ITALIEN (Fortsetzung)					
EUR	525.000	888 Acquisitions Limited 7.56% 15/07/2027	446.947	0,10	EUR	1.500.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	1.489.954	0,35
		Gibraltar, insgesamt	446.947	0,10	EUR	790.000	Telecom Italia SpA 6.88% 15/02/2028	808.338	0,19
GRIECHENLAND				ITALIEN, insgesamt					
EUR	2.400.000	Eurobank SA FRN 26/01/2029	2.339.648	0,55			8.062.168	1,88	
		Griechenland, insgesamt	2.339.648	0,55	JERSEY - KANALINSELN				
INDIEN				JERSEY - KANALINSELN					
USD	2.080.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	1.464.700	0,35	EUR	286.352	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	285.721	0,07
USD	1.729.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 4.25% 27/10/2027	1.397.684	0,32	EUR	6.500.000	Avis Budget Finance plc 4.13% 15/11/2024	6.479.692	1,51
		Indien, insgesamt	2.862.384	0,67	GBP	416.000	Heathrow Funding Limited 6.45% 10/12/2031	504.532	0,12
IRLAND				JERSEY - KANALINSELN, insgesamt					
EUR	1.275.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	1.156.400	0,27			7.269.945	1,70	
EUR	1.716.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	1.602.431	0,37	LUXEMBURG				
EUR	3.710.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	3.189.797	0,74	EUR	1.423.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	1.137.956	0,27
EUR	2.747.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	2.609.846	0,61	EUR	2.882.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	2.163.647	0,50
		Irland, insgesamt	8.558.474	1,99	EUR	3.300.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	2.215.220	0,52
INSEL MAN				LUXEMBURG					
EUR	1.207.547	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	1.204.162	0,28	EUR	3.600.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	2.241.273	0,52
		Insel Man, insgesamt	1.204.162	0,28	GBP	1.855.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	1.334.546	0,31
ITALIEN				LUXEMBURG					
EUR	709.000	Autostrade per l'Italia SpA 4.75% 24/01/2031	700.799	0,16	EUR	2.826.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	2.310.617	0,54
EUR	1.444.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	1.239.299	0,29	EUR	603.559	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	603.502	0,14
EUR	2.461.000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	2.198.288	0,51	EUR	1.613.000	Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	1.567.427	0,37
					EUR	437.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 6.75% 01/11/2025	336.622	0,08
					GBP	931.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.75% 01/11/2025	807.084	0,19
					EUR	2.100.000	Grand City Properties SA - Perp FRN	752.895	0,18
					EUR	6.124.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	5.224.512	1,22
					EUR	1.025.563	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	1.020.711	0,24
					EUR	1.500.000	Loarre Investments Sarl 6.50% 15/05/2029	1.400.085	0,33

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
LUXEMBURG (Fortsetzung)				NIEDERLANDE (Fortsetzung)					
EUR	840.000	Loarre Investments Sarl FRN 15/05/2029	810.587	0,19	EUR	1.038.000	Villa Dutch Bidco BV 9.00% 03/11/2029	984.104	0,23
EUR	3.200.000	Matterhorn Telecom SA 2.63% 15/09/2024	3.172.661	0,74	Niederlande, insgesamt				
EUR	3.835.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	2.884.242	0,66	85.693.920				
EUR	1.673.000	Sani/lkos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	1.556.251	0,36	10,66				
EUR	2.340.000	SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	2.150.756	0,50	SPANIEN				
Luxemburg, insgesamt				7,86	EUR	2.800.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	2.334.070	0,54
NIEDERLANDE					EUR	1.503.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	1.371.386	0,32
EUR	702.000	ASR Nederland NV FRN 07/12/2043	728.850	0,17	EUR	2.400.000	International Consolidated Airlines Group SA 0.50% 04/07/2023	2.377.794	0,56
EUR	1.000.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/01/2025	989.923	0,23	EUR	2.439.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	2.245.648	0,52
EUR	4.300.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	4.199.798	0,98	Spanien, insgesamt				
EUR	4.600.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/06/2169	3.520.986	0,82	8.328.898				
EUR	3.600.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/06/2170	3.109.287	0,73	1,94				
EUR	3.028.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	2.946.715	0,69	SCHWEDEN				
GBP	1.718.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	2.062.023	0,48	EUR	817.623	Intrum AB 3.13% 15/07/2024	787.017	0,18
USD	4.600.000	ING Groep NV FRN 16/11/2170	3.074.923	0,72	EUR	3.731.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	3.457.449	0,80
EUR	1.000.000	OI European Group BV 2.88% 15/02/2025	974.889	0,23	EUR	2.306.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	1.874.479	0,44
EUR	1.391.000	Sagax Euro Mtn NL BV 0.75% 26/01/2028	1.020.323	0,24	EUR	1.252.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	1.113.464	0,26
EUR	4.700.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	3.895.402	0,90	EUR	170.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	151.189	0,04
EUR	2.920.000	Stedin Holding NV - Perp FRN	2.458.514	0,57	EUR	380.000	Verisure Holding AB 7.13% 01/02/2028	381.169	0,09
EUR	3.140.000	Stichting AK Rabobank Certificaten 6.50% 29/03/2070	3.040.178	0,71	EUR	642.000	Verisure Holding AB 9.25% 15/10/2027	690.523	0,16
EUR	2.738.715	Summer BidCo BV 9.00% 15/11/2025	2.148.887	0,50	Schweden, insgesamt				
EUR	300.000	Telefonica Europe BV FRN 23/11/2171	306.068	0,07	8.455.290				
EUR	1.600.000	Telefonica Europe BV - Perp FRN	1.333.326	0,31	1,97				
EUR	900.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	880.514	0,21	SCHWEIZ				
EUR	4.200.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	3.154.511	0,74	USD	2.876.000	Credit Suisse AG 5.00% 09/07/2027	2.551.194	0,60
EUR	1.430.000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/08/2026	1.323.707	0,31	EUR	3.100.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	2.035.512	0,47
EUR	3.635.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	3.540.992	0,82	USD	5.205.000	UBS Group AG Perp FRN	4.552.287	1,06
					Schweiz, insgesamt				
					9.138.993				
					2,13				
					VEREINIGTES KÖNIGREICH				
EUR	2.300.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	1.713.146	0,40	EUR	2.300.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	1.713.146	0,40
GBP	1.973.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	1.467.257	0,34	GBP	1.973.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	1.467.257	0,34
EUR	2.838.000	British American Tobacco plc FRN 27/12/2169	2.316.608	0,54	EUR	2.838.000	British American Tobacco plc FRN 27/12/2169	2.316.608	0,54
GBP	397.500	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	421.973	0,10	GBP	397.500	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	421.973	0,10

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					
EUR	2.258.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	1.821.672	0,43	GBP	1.769.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	1.802.818	0,42
GBP	3.028.000	Co-Operative Bank Finance plcT FRN 06/04/2027	3.234.938	0,75	GBP	4.904.213	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	5.531.644	1,29
GBP	1.801.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	1.711.842	0,40	GBP	1.940.000	Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	1.955.072	0,46
EUR	3.308.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	3.057.584	0,71	EUR	1.490.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	1.208.422	0,28
EUR	6.500.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	6.336.285	1,48	EUR	695.000	Vmed O2 UK Financing I plc 3.25% 31/01/2031	568.864	0,13
EUR	6.600.000	HSBC Holdings plc FRN 04/01/2066	5.336.167	1,24	GBP	2.767.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.00% 31/01/2029	2.611.455	0,62
GBP	1.001.000	HSBC Holdings plc FRN 16/11/2034	1.198.124	0,28	USD	3.500.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	3.153.785	0,74
EUR	521.000	INEOS Finance plc 2.13% 15/11/2025	489.857	0,11	GBP	1.400.000	Western Power Distribution plc 3.50% 16/10/2026	1.504.886	0,35
EUR	1.337.000	INEOS Finance plc 3.38% 31/03/2026	1.254.423	0,29	GBP	3.634.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	3.128.935	0,73
EUR	1.217.000	INEOS Finance plc 6.63% 15/05/2028	1.229.062	0,29			Vereinigtes Königreich, insgesamt	82.716.784	19,31
EUR	787.000	INEOS Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	708.357	0,17	VEREINIGTE STAATEN				
EUR	294.217	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	292.807	0,07	EUR	2.541.000	Air Products and Chemicals Inc. 4.00% 03/03/2035	2.558.801	0,60
EUR	2.200.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	2.128.494	0,50	USD	1.426.000	Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	1.207.238	0,28
EUR	1.466.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	1.443.057	0,34	USD	932.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	877.562	0,20
GBP	2.376.000	Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	2.342.825	0,55	USD	2.578.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	2.439.177	0,58
GBP	1.251.766	Mitchells & Butlers Finance plc 5.57% 15/12/2030	1.380.650	0,32	EUR	2.086.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC 2.00% 01/09/2028	1.727.464	0,40
GBP	49.877	Mitchells & Butlers Finance plc 5.97% 15/12/2023	55.912	0,01	EUR	920.000	Bank of America Corp. FRN 24/05/2032	723.975	0,17
GBP	2.033.412	Mitchells & Butlers Finance plc 6.01% 15/12/2028	2.159.780	0,51	USD	1.853.000	Bank of America Corp. FRN 22/04/2032	1.424.515	0,33
EUR	1.117.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	1.095.554	0,26	EUR	2.453.000	Berkshire Hathaway Finance Corp. 1.50% 18/03/2030	2.159.228	0,50
EUR	2.253.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	1.823.853	0,43	EUR	1.050.000	Berry Global Inc. 1.00% 15/01/2025	998.735	0,23
EUR	1.856.000	NatWest Group plc FRN 14/09/2032	1.521.236	0,35	EUR	1.630.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	1.470.409	0,34
EUR	3.866.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	3.256.305	0,76	EUR	5.114.000	Digital Euro Finco LLC 1.13% 09/04/2028	4.196.423	0,99
EUR	2.140.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	1.984.758	0,46	EUR	1.208.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	1.189.044	0,28
GBP	3.100.000	Santander UK plc Perp 10.06% 15/11/2026	5.117.081	1,19	EUR	3.073.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	2.952.086	0,68
EUR	1.609.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	1.387.808	0,32	EUR	3.019.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.87% 03/08/2027	2.930.392	0,68
EUR	3.220.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	2.963.488	0,69	GBP	1.608.000	Ford Motor Credit Company LLC 6.86% 05/06/2026	1.828.210	0,43

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere						
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen						
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				NIEDERLANDE						
USD	2.819.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	2.174.032	0,51	USD	2.956.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	2.702.106	0,63	
USD	1.840.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	1.407.413	0,33	Niederlande, insgesamt			2.702.106	0,63	
USD	1.829.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	1.415.654	0,33	VEREINIGTE STAATEN					
USD	810.000	Lowe's Companies Inc. 5.80% 15/09/2062	753.530	0,18	USD	860.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	888.694	0,21	
GBP	962.000	Morgan Stanley FRN 18/11/2033	1.116.758	0,26	Vereinigte Staaten, insgesamt			888.694	0,21	
GBP	810.000	MPT Operating Partnership LP 2.55% 05/12/2023	877.354	0,20	Anleihen, insgesamt				3.590.800	0,84
EUR	1.242.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	1.198.965	0,28	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt				3.590.800	0,84
EUR	4.000.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	3.936.012	0,92	Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					
EUR	640.000	Netflix Inc. 4.63% 15/05/2029	654.259	0,15	Anleihen					
USD	845.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	821.975	0,19	AUSTRALIEN					
USD	775.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	783.328	0,18	USD	3.582.000	APA Infrastructure Limited 4.25% 15/07/2027	3.192.496	0,74	
USD	1.430.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	1.532.566	0,36	Australien, insgesamt			3.192.496	0,74	
USD	1.338.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	1.095.451	0,26	BERMUDAS					
EUR	4.149.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	4.052.255	0,95	USD	9.121.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	8.344.218	1,95	
GBP	3.515.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	3.862.174	0,90	Bermudas, insgesamt			8.344.218	1,95	
USD	5.735.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	4.286.037	1,00	PORTUGAL					
Vereinigte Staaten, insgesamt			58.651.022	13,69	EUR	12.900.000	Banco Espirito Santo SA 0.00% 21/01/2099**	1.419.000	0,33	
Anleihen, insgesamt			368.284.669	85,92	Portugal, insgesamt			1.419.000	0,33	
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				VEREINIGTES KÖNIGREICH						
DEUTSCHLAND				GBP	4.319.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	4.612.257	1,08		
GBP	11.400.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.88% 15/09/2026	11.645.664	2,72	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt				11.645.664	2,72
Deutschland, insgesamt			11.645.664	2,72	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt				379.930.333	88,64

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)			
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)			
GBP 2.009.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	1.915.016	0,45
	Vereinigtes Königreich, insgesamt	6.527.273	1,53
	Anleihen, insgesamt	19.482.987	4,55
	Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt	19.482.987	4,55

Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren

Fonds

IRLAND

10.122	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	1.000.544	0,23
951.941	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	1.083.370	0,25
45.545	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	41.921	0,01
33.057	Insight Liquidity Funds plc	37.621	0,01
	Irland, insgesamt	2.163.456	0,50
	Fonds, insgesamt	2.163.456	0,50
	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt	2.163.456	0,50
	Wert der Anlagen, insgesamt	405.167.576	94,53

(Gesamtkosten: EUR 456.035.102)

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

**Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)						
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)						
AUSTRALIEN				FRANKREICH						
EUR	174.000	APA Infrastructure Limited 1.25% 15/03/2033	128.293	0,72	USD	300.000	BNP Paribas SA FRN 12/07/2171	216.104	1,21	
USD	139.000	APA Infrastructure Limited 4.25% 15/07/2027	123.885	0,69	EUR	200.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	144.027	0,81	
EUR	100.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	76.294	0,43	EUR	100.000	BPCE SA FRN 02/03/2030	101.466	0,57	
EUR	228.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd 0.63% 25/08/2030	181.348	1,01	EUR	200.000	Credit Agricole SA 4.00% 18/01/2033	204.308	1,14	
EUR	190.000	Australia & New Zealand Banking Group Limited FRN 03/02/2033	190.265	1,06	EUR	100.000	Electricite de France SA 4.25% 25/01/2032	99.306	0,56	
EUR	100.000	NBN Company Limited 4.38% 15/03/2033	103.645	0,58	EUR	141.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	114.975	0,64	
GBP	110.000	Pacific National Finance Pty Limited 5.00% 19/09/2023	124.104	0,70	EUR	100.000	La Banque Postale SA FRN 26/01/2031	88.352	0,49	
USD	150.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	133.299	0,75	Frankreich, insgesamt			968.538	5,42	
Australien, insgesamt				1.061.133	5,94	DEUTSCHLAND				
BELGIEN				DEUTSCHLAND						
EUR	200.000	Elia Transmission Belgium SA 0.88% 28/04/2030	167.864	0,94	EUR	300.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	247.989	1,38	
EUR	200.000	Kbc Group NV Perp FRN	169.069	0,95	EUR	300.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	221.740	1,24	
Belgien, insgesamt				336.933	1,89	EUR	100.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	82.365	0,46
KAIMANINSELN				DEUTSCHLAND						
GBP	100.000	Southern Water Services Finance Limited 2.38% 28/05/2028	98.579	0,55	EUR	100.000	Commerzbank AG FRN 18/01/2030	98.622	0,55	
GBP	200.000	Thames Water Kemble Finance plc 2.38% 03/05/2023	227.008	1,27	EUR	200.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	157.876	0,88	
Kaimaninseln, insgesamt				325.587	1,82	EUR	1.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.01% 05/05/2027	889.494	4,97
DÄNEMARK				DEUTSCHLAND						
USD	242.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	195.066	1,09	EUR	300.000	Vier Gas Transport GmbH 4.63% 26/09/2032	309.920	1,73	
Dänemark, insgesamt				195.066	1,09	Deutschland, insgesamt			2.008.006	11,21
FINNLAND				IRLAND						
EUR	203.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	172.132	0,96	EUR	125.000	Aib Group plc FRN 30/05/2031	113.373	0,63	
Finnland, insgesamt				172.132	0,96	EUR	190.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	163.359	0,91
ITALIEN				IRLAND						
EUR	140.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	113.536	0,63	Irland, insgesamt			276.732	1,54	
Italien, insgesamt				113.536	0,63	ITALIEN				
JERSEY - KANALINSELN				JERSEY - KANALINSELN						
GBP	96.000	Heathrow Funding Limited 6.45% 10/12/2031	116.431	0,65	Jersey - Kanalinseln, insgesamt				116.431	0,65

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
LUXEMBURG				SCHWEIZ (Fortsetzung)					
EUR	200.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	134.256	0,75	EUR	100.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	65.662	0,37
EUR	200.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	124.515	0,70	USD	200.000	UBS Group AG Perp FRN	174.920	0,98
EUR	100.000	Grand City Properties SA 0.13% 11/01/2028	70.704	0,40	Schweiz, insgesamt				
EUR	200.000	Grand City Properties SA - Perp FRN	71.704	0,40	424.551 2,38				
USD	200.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl 6.13% 23/02/2038	189.732	1,07	VEREINIGTES KÖNIGREICH				
EUR	268.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	201.558	1,13	GBP	149.000	Anglian Water Osprey Financing plc 2.00% 31/07/2028	136.929	0,77
EUR	231.000	SELP Finance Sarl 3.75% 10/08/2027	212.318	1,19	EUR	100.000	Anglo American Capital plc 5.00% 15/03/2031	102.725	0,57
Luxemburg, insgesamt				5,64	EUR	100.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	74.485	0,42
					GBP	300.000	BAT International Finance plc 2.25% 26/06/2028	280.910	1,57
					USD	69.000	BP Capital Markets plc FRN 22/09/2168	60.917	0,34
					GBP	100.000	Co-Operative Bank Finance plcT FRN 06/04/2027	106.834	0,60
					EUR	32.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	31.194	0,17
					EUR	438.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	426.967	2,38
					EUR	400.000	HSBC Holdings plc FRN 04/01/2066	323.403	1,81
					GBP	100.000	HSBC Holdings plc FRN 16/11/2034	119.693	0,67
					GBP	40.187	Marston's Issuer plc FRN 15/10/2027	42.253	0,24
					GBP	85.086	Mitchells & Butlers Finance plc FRN 15/12/2028	88.724	0,50
					EUR	100.000	National Grid Electricity Distribution East Midlands plc 3.95% 20/09/2032	98.080	0,55
					EUR	210.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	170.000	0,95
					EUR	213.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	179.408	1,00
					GBP	100.000	Northumbrian Water Finance plc 4.50% 14/02/2031	108.176	0,60
					GBP	150.000	Santander UK plc Perp 10.06% 7.62% 13/07/2039	247.601	1,38
					GBP	161.706	Tesco Property Finance 1 plc 0.25% 14/09/2028	208.218	1,16
					EUR	200.000	Thames Water Kemble Finance plc 0.19% 23/10/2023	196.317	1,10
					GBP	100.000	Wessex Water Services Finance plc 5.13% 31/10/2032	112.398	0,63
					Vereinigtes Königreich, insgesamt			3.115.232	17,41
SCHWEIZ									
EUR	100.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	78.910	0,44					
EUR	160.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	105.059	0,59					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen					
VEREINIGTE STAATEN				NIEDERLANDE					
EUR	156.000	Air Products and Chemicals Inc. 4.00% 03/03/2035	157.093	0,88	USD	50.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	45.705	0,26
USD	250.000	Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	211.648	1,18	Niederlande, insgesamt				
USD	94.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2030	88.509	0,49	45.705 0,26				
USD	232.000	Amgen Inc. 5.25% 02/03/2033	219.507	1,24	Anleihen, insgesamt				
USD	147.000	Bank of America Corp. FRN 22/04/2032	113.008	0,63	45.705 0,26				
EUR	289.000	Digital Euro Finco LLC 1.13% 09/04/2028	237.146	1,33	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt				
USD	181.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	139.588	0,78	45.705 0,26				
USD	131.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	101.395	0,57	Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				
EUR	248.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	239.407	1,34	Anleihen				
USD	119.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	97.428	0,54	BERMUDAS				
USD	200.000	Stellantis Finance USA Inc. 6.38% 12/09/2032	193.219	1,08	USD	233.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	213.157	1,19
GBP	195.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	214.260	1,20	Bermudas, insgesamt				
USD	316.000	Warnermedia Holdings Inc. 5.14% 15/03/2052	236.162	1,32	213.157 1,19				
Vereinigte Staaten, insgesamt			2.248.370	12,58	Anleihen, insgesamt				
Anleihen, insgesamt			14.691.804	82,16	213.157 1,19				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldsinstrumente				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren					
DEUTSCHLAND				Fonds					
GBP	700.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.13% 04/07/2025	746.360	4,17	IRLAND				
Deutschland, insgesamt			746.360	4,17	7.720	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	763.152	4,27	
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldsinstrumente, insgesamt				746.360	4,17	Irland, insgesamt			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt				15.438.164	86,33	Fonds, insgesamt			
						763.152 4,27			
						Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt			
						763.152 4,27			
						Wert der Anlagen, insgesamt			
						16.460.178 92,05			
						(Gesamtkosten: EUR 18.185.794)			

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
DÄNEMARK				SCHWEIZ			
26.619	Novo Nordisk AS	3.879.952	4,97	21.107	Compagnie Financiere Richemont SA - Reg	3.102.700	3,97
22.018	Pandora A/S	1.937.176	2,48	18.528	Novartis AG - Reg	1.563.591	2,00
	Dänemark, insgesamt	5.817.128	7,45	3.470	Swatch Group AG - B	1.095.687	1,40
				196.979	UBS Group AG	3.828.337	4,91
					Schweiz, insgesamt	9.590.315	12,28
FRANKREICH				VEREINIGTES KÖNIGREICH			
18.908	Air Liquide SA	2.915.614	3,73	199.217	3i Group plc	3.820.262	4,89
63.340	Compagnie de Saint-Gobain	3.313.949	4,24	55.689	Burberry Group plc	1.638.946	2,10
871	Hermes International	1.623.544	2,08	18.055	Compass Group plc	417.736	0,53
1.347	Kering SA	808.200	1,04	59.716	InterContinental Hotels Group plc	3.610.070	4,62
4.523	Legrand SA	380.294	0,49	113.102	RELX plc	3.369.820	4,32
8.675	L'Oreal SA	3.567.594	4,57		Vereinigtes Königreich, insgesamt	12.856.834	16,46
4.520	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	3.816.687	4,89		Aktien, insgesamt	73.806.142	94,51
18.450	Pernod-Ricard SA	3.850.515	4,93		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	73.806.142	94,51
49.718	Publicis Groupe SA	3.568.758	4,57				
	Frankreich, insgesamt	23.845.155	30,54		Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren		
					Fonds		
DEUTSCHLAND				IRLAND			
30.804	Beiersdorf AG	3.694.940	4,73	17.816	BlackRock ICS Euro Liquidity Fund	1.761.093	2,26
	Deutschland, insgesamt	3.694.940	4,73		Irland, insgesamt	1.761.093	2,26
					Fonds, insgesamt	1.761.093	2,26
ITALIEN				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt			
47.063	Moncler SpA	2.990.383	3,83		Wert der Anlagen, insgesamt	75.567.235	96,77
	Italien, insgesamt	2.990.383	3,83		(Gesamtkosten: EUR 68.115.751)		
JERSEY - KANALINSELN				<i>*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.</i>			
333.818	WPP plc	3.641.782	4,66				
	Jersey - Kanalinseln, insgesamt	3.641.782	4,66				
NIEDERLANDE							
2.241	ASM International NV	833.428	1,07				
1.363	ASML Holding NV	852.148	1,09				
51.794	Davide Campari-Milano NV	582.683	0,75				
40.672	STMicroelectronics NV	1.991.097	2,55				
18.622	Wolters Kluwer NV	2.166.670	2,77				
	Niederlande, insgesamt	6.426.026	8,23				
SCHWEDEN							
134.549	Epiroc AB	2.457.850	3,15				
127.408	Sandvik AB	2.485.729	3,18				
	Schweden, insgesamt	4.943.579	6,33				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
KANADA				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
13.212	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	743.703	0,84	18.065	Salesforce Inc.	3.609.025	4,06
	Kanada, insgesamt	743.703	0,84	37.314	Schnitzer Steel Industries Inc.	1.160.465	1,31
				393.139	Sharecare Inc.	558.257	0,63
				6.315	Sherwin-Williams Company	1.419.423	1,60
				4.704	Shift4 Payments Inc.	356.563	0,40
				14.078	Stanley Black & Decker Inc.	1.134.405	1,28
				63.592	State Street Corp.	4.813.278	5,42
				29.050	Teradata Corp.	1.170.134	1,32
				6.949	Teradyne Inc.	747.087	0,84
				19.789	TransUnion	1.229.689	1,38
				10.880	Trimble Inc.	570.330	0,64
				89.177	Uber Technologies Inc.	2.826.911	3,18
				5.689	United Parcel Service Inc.	1.103.609	1,24
				5.719	Vertex Pharmaceuticals Inc.	1.801.885	2,02
				22.793	Voya Financial Inc.	1.628.788	1,83
				4.710	Walt Disney Company	471.612	0,53
				25.276	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	1.184.939	1,33
				14.777	Xponential Fitness Inc.	449.073	0,51
					Vereinigte Staaten, insgesamt	83.701.506	94,18
					Aktien, insgesamt	87.275.196	98,20
					Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	87.275.196	98,20
					Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren		
					Fonds		
					IRLAND		
				520.573	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	520.573	0,59
					Irland, insgesamt	520.573	0,59
					Fonds, insgesamt	520.573	0,59
					Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt	520.573	0,59
					Wert der Anlagen, insgesamt	87.795.769	98,79
					(Gesamtkosten: USD 90.132.022)		

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
AUSTRALIEN				JAPAN			
3.874	CSL Limited	748.027	0,92	3.400	Keyence Corp.	1.646.479	2,04
	Australien, insgesamt	748.027	0,92	11.300	Sony Group Corp.	1.017.586	1,26
KANADA				NIEDERLANDE			
6.865	Nutrien Limited	506.296	0,63	10.742	Akzo Nobel NV	840.053	1,04
	Kanada, insgesamt	506.296	0,63	5.286	Koninklijke DSM NV	624.261	0,77
DÄNEMARK				NORWEGEN			
6.107	Novo Nordisk AS	967.102	1,19	43.152	Equinor ASA	1.230.728	1,52
14.739	Orsted A/S	1.254.091	1,54		Norwegen, insgesamt	1.230.728	1,52
	Dänemark, insgesamt	2.221.193	2,73	SÜDKOREA			
FRANKREICH				SINGAPUR			
26.964	AXA SA	825.095	1,02	50.200	DBS Group Holdings Limited	1.245.985	1,54
3.603	EssilorLuxottica SA	649.804	0,80		Singapur, insgesamt	1.245.985	1,54
1.956	L'Oreal SA	873.946	1,08	SCHWEIZ			
902	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	827.493	1,02	1.368	Lonza Group AG - Reg	819.707	1,01
5.310	Schneider Electric SE	886.588	1,09		Schweiz, insgesamt	819.707	1,01
38.973	TotalEnergies SE	2.301.723	2,85	TAIWAN			
	Frankreich, insgesamt	6.364.649	7,86	108.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	1.890.574	2,34
DEUTSCHLAND				VEREINIGTES KÖNIGREICH			
3.514	Adidas AG	621.459	0,77	20.454	Anglo American plc	677.276	0,84
	Deutschland, insgesamt	621.459	0,77	22.167	Diageo plc	990.539	1,22
INDIEN				16.953	Reckitt Benckiser Group plc	1.290.811	1,59
237.673	HDFC Bank Limited	4.654.827	5,74	40.657	Shell plc	1.160.491	1,43
54.599	Kotak Mahindra Bank Limited	1.151.237	1,42	42.853	SSE plc	955.330	1,18
	Indien, insgesamt	5.806.064	7,16		Vereinigtes Königreich, insgesamt	5.074.447	6,26
INDONESIEN				IRLAND			
1.759.949	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	555.165	0,69	896	CRH plc	45.242	0,06
	Indonesien, insgesamt	555.165	0,69	3.920	Linde plc	1.393.325	1,72
					Irland, insgesamt	1.438.567	1,78

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Aktien (Fortsetzung)				Fonds			
VEREINIGTE STAATEN				IRLAND			
10.515	Abbott Laboratories	1.064.749	1,31	2.255.696	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.255.696	2,79
1.214	Adobe Inc.	467.839	0,58		Irland, insgesamt	2.255.696	2,79
6.115	Advanced Micro Devices Inc.	599.331	0,74		Fonds, insgesamt	2.255.696	2,79
2.041	Alphabet Inc. - A	211.713	0,26		Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt	2.255.696	2,79
38.905	Amazon.com Inc.	4.018.498	4,97		Wert der Anlagen, insgesamt	73.822.965	91,16
3.305	Cooper Companies Inc.	1.233.954	1,53		(Gesamtkosten: USD 70.911.032)		
4.170	Crowdstrike Holdings Inc. - A	572.374	0,71				
1.856	Deere & Company	766.305	0,95				
13.904	Ecolab Inc.	2.301.529	2,84				
9.143	Electronic Arts Inc.	1.101.274	1,36				
2.808	Elevance Health Inc.	1.291.146	1,59				
4.376	Eli Lilly & Company	1.502.806	1,86				
642	Equinix Inc.	462.908	0,57				
8.077	IntercontinentalExchange Inc.	842.350	1,04				
4.837	Intuit Inc.	2.156.480	2,66				
2.986	JPMorgan Chase & Company	389.106	0,48				
3.192	Mastercard Inc. - A	1.160.005	1,43				
1.403	Mercadolibre Inc.	1.849.238	2,29				
14.375	Micron Technology Inc.	867.388	1,07				
9.829	NextEra Energy Inc.	757.619	0,94				
4.167	NVIDIA Corp.	1.157.468	1,43				
10.277	ON Semiconductor Corp.	846.003	1,04				
9.437	Paypal Holdings Inc.	716.646	0,88				
7.597	PepsiCo Inc.	1.384.933	1,71				
11.171	QUALCOMM Inc.	1.425.196	1,76				
2.395	Thermo Fisher Scientific Inc.	1.380.406	1,70				
22.200	T-Mobile USA Inc.	3.215.448	3,97				
15.502	Trimble Inc.	812.615	1,00				
51.644	Uber Technologies Inc.	1.637.115	2,02				
3.855	Union Pacific Corp.	775.857	0,96				
11.248	Walt Disney Company	1.126.262	1,39				
	Vereinigte Staaten, insgesamt	38.094.561	47,04				
	Aktien, insgesamt	71.567.269	88,37				
	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt	71.567.269	88,37				

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2023

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere						
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente						
VEREINIGTE STAATEN				VEREINIGTE STAATEN						
USD	19.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 07/09/2023	18.613.453	9,33	USD	29.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 11/04/2023	28.970.516	14,52	
		Vereinigte Staaten, insgesamt	18.613.453	9,33	USD	29.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 18/04/2023	28.945.022	14,51	
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt				18.613.453	9,33	USD	30.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 25/04/2023	29.916.903	15,00
Strukturierte Instrumente - Rohstoffe						USD	32.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 04/05/2023	31.874.828	15,99
IRLAND						USD	32.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 11/05/2023	31.846.141	15,97
	1.563	Invesco Physical Gold ETC 0.00%	298.689	0,15	USD	17.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 18/05/2023	16.902.570	8,47	
		Irland, insgesamt	298.689	0,15			Vereinigte Staaten, insgesamt	168.455.980	84,46	
Strukturierte Instrumente - Rohstoffe, insgesamt				298.689	0,15	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt				
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt				18.912.142	9,48	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt				
						Wert der Anlagen, insgesamt	187.368.122	93,94		
						(Gesamtkosten: USD 186.671.892)				

*Geringfügige Differenzen aufgrund von Rundungen.

Erläuterungen zum Abschluss

1 ALLGEMEINES

Threadneedle (Lux) (die „SICAV“) ist eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (*Société d'Investissement à Capital Variable*), die den Vorschriften von Teil I des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen unterliegt.

Die SICAV bietet Anlegern die Möglichkeit, Anlagen in separaten Teilfonds (die „Portfolios“) zu tätigen, die jeweils unterschiedliche Anlageziele haben und getrennt geführte Vermögensportfolios sind, die separate Wertpapiere umfassen. Jedes Portfolio kann eine oder mehrere entsprechende Anteilklassen (die „Anteilklassen“) haben. Die SICAV als Ganzes, einschließlich der bestehenden und aller künftigen Portfolios, ist eine ungeteilte juristische Person. Im Verhältnis zu Dritten, insbesondere in Bezug auf die Gläubiger der SICAV und im Verhältnis zwischen den Anteilhabern haftet jedoch jedes Portfolio ausschließlich für die ihm zuzurechnenden Verbindlichkeiten.

Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres:

Neue Verkaufsprospekte

Neue Verkaufsprospekte wurden im Juli 2022 und im Januar 2023 herausgegeben.

Reduzierung der Gebühren und Aufwendungen

Ab dem 1. August 2022 wurden die Anlageverwaltungsgebühren und die Betriebskosten für einige Anteilklassen mehrerer Portfolios gesenkt, wie in Erläuterung 5 angegeben.

Schließung des Portfolios

Mit Wirkung zum 21. Mai 2021 wurde für das Threadneedle (Lux) – STANLIB Africa Equity Portfolio ein Liquidationsverfahren eingeleitet und die letzte Rücknahme erfolgte am 23. Januar 2023.

Aufgelegte Anteilklassen

Im Berichtsjahr zum 31. März 2023 wurden folgende Anteilklassen aufgelegt:

Anteilklasse	Portfolio	Auflegungsdatum
ASH	Threadneedle (Lux) - Global Focus	27. April 2022
ASH	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	27. April 2022

Im Berichtsjahr zum 31. März 2023 wurden folgende Anteilklassen geschlossen:

AEP	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	23. März 2023
IE	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	27. März 2023
IEP	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	23. März 2023
LE	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	28. März 2023
LEP	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	23. März 2023
ZE	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	23. März 2023
ZEP	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	23. März 2023

Zum 31. März 2023 lauten die aktiven Portfolios der SICAV wie folgt:

Die Anleiheportfolios:

- Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) - European Social Bond
- Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond
- Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds¹
- Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt
- Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds¹
- Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond¹
- Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Die Vermögensallokationsportfolios:

- Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

1 ALLGEMEINES

(Fortsetzung)

Die Aktienportfolios:

- Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities
- Threadneedle (Lux) - Global Focus¹
- Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities¹
- Threadneedle (Lux) - Global Equity Income
- Threadneedle (Lux) - Global Select
- Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - American¹
- Threadneedle (Lux) - American Select
- Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity¹
- Threadneedle (Lux) - Asia Equities
- Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities
- Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities
- Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities
- Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend
- Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities¹
- Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - European Select
- Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income¹
- Threadneedle (Lux) - Global Technology¹
- Threadneedle (Lux) - UK Equities
- Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

Die Absolute-Return-Portfolios:

- Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha
- Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

Die Extended-Alpha-Portfolios:

- Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha
- Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

Das Specialist-Portfolio:

- Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

¹Diese Portfolios wurden zum 31. März 2023 von der Securities and Futures Commission in Hongkong zugelassen und sind in Hongkong für die Öffentlichkeit verfügbar.

2 ZUSAMMENFASSUNG DER WESENTLICHEN RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE

Der Abschluss wurde im Einklang mit den in Luxemburg allgemein anerkannten Grundsätzen der Rechnungslegung erstellt und vorgelegt, die für als OGAW (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) zugelassene Fonds gelten, und seine Erstellung erfordert Schätzungen und Annahmen seitens des Fondsmanagements, welche die im Abschluss und den Erläuterungen ausgewiesenen Beträge beeinflussen. Die tatsächlichen Ergebnisse können von diesen Schätzungen abweichen.

Der Abschluss wird auf der Grundlage der Nettoinventarwerte der Portfolios erstellt, die zum 31. März 2023 berechnet werden. Der letzte offizielle Handelsnettoinventarwert der entsprechenden Portfolios wurde zum 31. März 2023 berechnet.

Der Jahresabschluss wurde gemäß den gesetzlichen Bestimmungen und Anforderungen des Großherzogtums Luxemburg in Bezug auf Investmentfonds nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt, ausgenommen für die Portfolios Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity Portfolio (Einleitung des Liquidationsverfahrens zum 21. Mai 2021 und letztmalige Rücknahme von Anteilen am 23. Januar 2023), Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return Portfolio (Einleitung des Liquidationsverfahrens zum 28. April 2023) sowie Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities Portfolio und Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolio (Einleitung des Liquidationsverfahrens zum 13. Juli 2023). Dementsprechend wurde der Abschluss für diese Portfolios nicht nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt, und alle zusätzlichen Kosten im Zusammenhang mit der Schließung dieser Portfolios trägt die Verwaltungsgesellschaft.

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

2 ZUSAMMENFASSUNG DER WESENTLICHEN RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE

(Fortsetzung)

I) *Bewertung der Wertpapiere*

Übertragbare Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Finanzwerte, die an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden, werden zu ihrem letzten Börsenkurs am entsprechenden Markt zum Zeitpunkt der Schließung des Marktes bewertet. Falls die Kurse dieser Wertpapiere nicht für deren fairen Marktwert repräsentativ sind, werden sie zu dem beizulegenden Zeitwert ausgewiesen, zu dem sie sich erwartungsgemäß wiederverkaufen lassen und den der Verwaltungsrat nach Treu und Glauben festlegt oder gemäß seinen Anweisungen festlegen lässt.

Die festverzinslichen Wertpapiere, die nicht auf diesen Märkten gehandelt werden, werden zum zuletzt verfügbaren Kurs, zu den Zinsgegenwerten der vom Verwaltungsrat genehmigten Händler oder Kursstellungsdienste oder zu einem anderen vom Verwaltungsrat für angemessen erachteten Kurs bewertet.

Geldmarktinstrumente (oder sonstige Instrumente, die in der Rechtsordnung, in der das Instrument gehalten wird, den Marktgrundsätzen entsprechen) mit einer Restlaufzeit von maximal 90 Tagen werden gemäß der Restbuchwertmethode (amortized cost method) bewertet, die in etwa den Marktwert widerspiegelt. Bei dieser Bewertungsmethode werden die entsprechenden Portfolioanlagen zu ihren Anschaffungskosten bzw. zu dem letzten, vor Beginn der 90-Tage-Frist verfügbaren Marktwert (sofern ein Instrument am Kaufdatum ursprünglich eine Restlaufzeit von mehr als 90 Tagen hatte), angepasst um die Abschreibung des Aufschlags oder des Abschlags, und nicht zum Marktwert bewertet.

Die Anteile offener Organismen für gemeinsame Anlagen („OGA“) werden zu ihrem zuletzt festgestellten und verfügbaren Nettoinventarwert (der „Nettoinventarwert“) bewertet. Falls die Preise dieser Vermögenswerte für deren beizulegenden Marktwert nicht repräsentativ sind, werden sie von der SICAV nach Treu und Glauben festgelegt. Die Anteile geschlossener OGA werden zu ihrem letztverfügbaren Kurswert bewertet.

Der Verwaltungsrat der SICAV (der „Verwaltungsrat“) kann in eigenem Ermessen die Verwendung anderer Bewertungsmethoden genehmigen, wenn er der Ansicht ist, dass sie den beizulegenden Zeitwert eines Vermögenswerts der SICAV besser wiedergeben.

II) *Devisenterminkontrakte*

Zur Absicherung besonderer Währungsrisiken bzw. zur Anlage in anderen Währungen darf die SICAV Devisenterminkontrakte eingehen. Zum Ende des Geschäftsjahres wurden die offenen Devisenterminkontrakte zu den Terminkursen bewertet, die für die Restlaufzeit bis Fälligkeit gültig waren. Die Nettobewegung der entstandenen nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus Devisenterminkontrakten ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen. Die zum 31. März 2023 offenen Kontrakte sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

III) *Terminkontrakte*

Die SICAV kann Devisenterminkontrakte eingehen. Offene Terminkontrakte werden zu den Kursen an der Börse bewertet, an denen die Kontrakte gehandelt werden. Die Nettobewegung der entstandenen nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus Terminkontrakten ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen. Die zum 31. März 2023 offenen Kontrakte sind in Erläuterung 11 aufgeführt.

IV) *Swaps*

Die SICAV darf Zinsswaps („IRS“), Credit Default Swaps („CDS“) und Total Return Swaps („TRS“) abschließen. Zinsswaps (IRS) werden auf Basis ihres Marktwerts bewertet, der sich aus der gültigen Zinskurve ergibt. CDS werden unter Bezug auf den aktuellen Nettowert des erwarteten zukünftigen Cashflows basierend auf den marktüblichen Zinssätzen und der an dem Markt zu erwartenden Ausfall- und Rückgewinnungsrate der zugrunde liegenden Vermögenswerte bewertet. Eine gegebenenfalls von der SICAV geleistete Vorauszahlung wird in der Aufstellung des Nettovermögens als Vermögenswert ausgewiesen. Eine gegebenenfalls von der SICAV erhaltene Vorauszahlung wird in der Aufstellung des Nettovermögens als Verbindlichkeit ausgewiesen. TRS werden anhand ihres Marktwerts bewertet, der auf dem Marktwert des Basiswerts basiert. Die Nettobewegung der entstandenen nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus Swap-Geschäften ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen. Die zum 31. März 2023 offenen Kontrakte sind in Erläuterung 10 aufgeführt. Die ggf. auf Swap-Short-Positionen zahlbaren Dividenden werden in der Aufstellung des Nettovermögens als Verbindlichkeit ausgewiesen.

V) *Optionen*

An einem geregelten Markt gehandelte Optionen werden zum Marktpreis am Tag der Bewertung bewertet. Diese zum 31. März 2023 offenen Optionen sind dem Anlageverzeichnis zu entnehmen. Over the Counter („OTC“)-Optionen werden zu Preisen bewertet, die von externen Preisagenturen/Modellen bereitgestellt werden. Diese zum 31. März 2023 offenen Optionen sind in Erläuterung 12 aufgeführt. Zum Zeitpunkt der Berichterstellung durch die Bewertung von Optionsgeschäften entstandene nicht realisierte Gewinne oder Verluste werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen.

VI) *Währungsumrechnung*

Die Konten eines Portfolios werden in der Währung geführt, in der dessen Nettovermögen ausgedrückt ist. Auf diese Währung (die „Basiswährung“) lauten auch jeweils die Aufstellung des Nettovermögens, die Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens sowie das Anlageverzeichnis.

Während des Jahres wurden Transaktionen, Erträge und Aufwendungen, die auf eine andere Währung als die Basiswährung lauten, auf Basis der Wechselkurse verbucht, die an dem Datum, an dem sie erfolgten oder im Portfolio anfielen, gültig waren.

Zum Datum der Aufstellung des Nettovermögens werden monetäre Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf eine andere Währung als die Basiswährung lauten, auf Basis der an diesem Datum geltenden Wechselkurse in die Basiswährung umgerechnet. Wechselkursdifferenzen sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen.

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

2 ZUSAMMENFASSUNG DER WESENTLICHEN RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE

(Fortsetzung)

Die konsolidierte Aufstellung des Nettovermögens sowie die konsolidierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens werden in USD vorgelegt. Sie beruhen auf den Wechselkursen, die am Datum der Aufstellung des Nettovermögens gültig waren. Wechselkurse zum 31. März 2023: 1 USD = 1,493094 AUD, 1 USD = 0,920429 EUR, 1 USD = 0,808767 GBP, 1 USD = 0,913550 CHF, 1 USD = 10,369572 SEK, 1 USD = 6,856547 DKK, 1 USD = 10,473069 NOK, 1 USD = 7,849971 HKD, 1 USD = 1,329550 SGD.

Die Differenz zwischen dem Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums, das zu den zu Beginn des Geschäftsjahres geltenden Wechselkursen ausgewiesen ist, und dessen Wert am Ende des Geschäftsjahres wird als Umrechnungsanpassung in der konsolidierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens unter der Überschrift „Wechselkursdifferenzen“ ausgewiesen.

VII) Bankguthaben

Das in der Aufstellung des Nettovermögens angegebene Bankguthaben beinhaltet auch die Margins auf Terminkontrakten und die von den Portfolios gezahlten Barsicherheiten für Swapgeschäfte und Devisenterminkontrakte.

Bankguthaben und Margins auf Terminkontrakten werden zu Anschaffungskosten bewertet, was in etwa dem Marktwert entspricht.

VIII) Termineinlagen

Termineinlagen werden zu Anschaffungskosten bewertet, was in etwa dem Marktwert entspricht.

IX) Anlagetransaktionen und Anlageertrag

Wertpapiere werden zum Anschaffungspreis und ggf. auf der Grundlage der am Kauftag geltenden Wechselkurse ausgewiesen.

Einnahmen aus dem Verkauf von Wertpapieren werden auf der Basis der Durchschnittskostenmethode ermittelt. Anlagetransaktionen werden zum Transaktionsdatum abgerechnet. Dividenden werden zum Ex-Dividenden-Datum abgerechnet. Zinserträge werden bei ihrem Anfallen ausgewiesen. Abschläge/Aufschläge auf Nullkuponanleihen werden als Anpassungen mit den Zinserträgen verrechnet.

Zinsen, Dividenden und Kapitalerträge auf Wertpapiere können in bestimmten Ländern einer Quellen- oder Kapitalertragssteuer unterliegen.

X) Ausschüttungspolitik

Gemäß der Ausschüttungspolitik der SICAV sind für keine der Anteilklassen der Portfolios Ausschüttungen vorgesehen, mit Ausnahme der Klassen, deren Bezeichnung mit „C“, „M“, „P“ oder „T“ endet. Die SICAV beabsichtigt, für die Klassen, deren Bezeichnung mit „C“, „M“, „P“ oder „T“ endet, regelmäßig (mindestens jährlich) Ausschüttungen in einer vom Verwaltungsrat festzulegenden Höhe durchzuführen. Die Anteilinhaber dieser Anteilklassen können sich entweder für eine Ausschüttung oder eine Wiederanlage der Erträge in dieselbe Anteilklasse entscheiden.

XI) Rückvergütungen von Anlageverwaltungsgebühren

Überkreuzbeteiligungen und Anlagen in anderen Fonds von Columbia Threadneedle werden entweder in nicht gebührenpflichtigen Anteilklassen getätigt oder die gezahlte Verwaltungsgebühr wird vollständig zurückerstattet. Bitte lesen Sie auch Erläuterung 18, die Einzelheiten zu Überkreuzbeteiligungen enthält.

3 BESTEUERUNG

Gemäß der aktuellen Gesetzgebung und Praxis unterliegt die SICAV keiner luxemburgischen Ertrags- oder Kapitalertragssteuer auf den realisierten Wertzuwachs ihrer Vermögenswerte, und auch die durch die SICAV ausgeschütteten Dividenden unterliegen keiner luxemburgischen Quellensteuer.

Gemäß den geltenden Gesetzen und Vorschriften unterliegt die SICAV im Großherzogtum Luxemburg einer jährlichen Steuer („*taxe d'abonnement*“) in Höhe von 0,05 %, die sich aus ihrem Nettoinventarwert am Ende eines Quartals herleitet und vierteljährlich abzuführen ist. Auf die von der SICAV gehaltenen Vermögenswerte anderer OGAW, die bereits dieser luxemburgischen Steuer unterliegen, fällt keine Steuer an.

Für institutionelle Anteilklassen wird am letzten Tag eines jeden Kalenderquartals in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 17. Dezember 2010 in der jeweils gültigen Fassung eine verringerte jährliche Zeichnungssteuer von 0,01 % auf den Nettoinventarwert erhoben.

Auch für Portfolios, deren einziges Ziel in der gemeinsamen Anlage in Geldmarktinstrumenten und der Platzierung von Einlagen bei Kreditinstituten besteht, gilt eine verringerte Steuer von 0,01 %. Diese Steuer fällt ebenfalls nicht auf den Anteil des Vermögens der SICAV an, der gegebenenfalls in anderen luxemburgischen OGAW angelegt ist.

Zur Klarstellung. Diese *taxe d'abonnement* ist Bestandteil der Betriebskosten der SICAV.

Obwohl die realisierten Kapitalerträge der SICAV, ganz gleich ob kurz- oder langfristig, in Luxemburg nicht versteuert werden müssen, können sie in den Herkunftsländern der Steuerpflicht unterliegen.

4 SONSTIGE GEBÜHREN

Die sonstigen Gebühren setzen sich hauptsächlich aus Strafen gemäß der Central Securities Depositories Regulation und Ausgleichszahlungen an durch NIW-Fehler benachteiligte Anleger zusammen.

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

Die SICAV kann im Namen der verschiedenen Portfolios Kreditaufnahmen (vorbehaltlich der Beschränkungen unter „Anlagebeschränkungen“ in Anhang A des Verkaufsprospekts) sowie den Kauf oder Verkauf von übertragbaren Wertpapieren, Devisen oder sonstigen Finanzinstrumenten über die Threadneedle Asset Management Limited („TAML“), eine verbundene Partei und ihre verbundenen Unternehmen tätigen, sofern diese Geschäfte nach dem Fremdvergleichsprinzip und zu üblichen Handelsbedingungen ausgeführt werden und im besten Interesse der betreffenden Portfolios und ihrer Anteilinhaber liegen.

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2023 ging die SICAV keine Transaktionen mit verbundenen Personen ein.

Die SICAV hat Threadneedle Management Luxembourg S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“) gemäß Kapitel 15 des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 in der jeweils gültigen Fassung zu ihrer bezeichneten Verwaltungsgesellschaft ernannt. Gemäß der Verwaltungsgesellschaftsvereinbarung erbringt die Verwaltungsgesellschaft vorbehaltlich der allgemeinen Aufsicht und Kontrolle durch den Verwaltungsrat Anlageverwaltungs-, Verwaltungs- und Marketingdienstleistungen für die SICAV.

Weder die Verwaltungsgesellschaft noch TAML haben Provisionen für Maklertransaktionen erhalten.

Gewisse Führungskräfte und/oder Verwaltungsratsmitglieder der Verwaltungsgesellschaft, der SICAV und von anderen Unternehmen von Columbia Threadneedle Group sind auch Führungskräfte und/oder Verwaltungsratsmitglieder von TAML.

Die Verwaltungsgesellschaft hat (im Namen der SICAV) bestimmte Marketing- bzw. Vertriebsfunktionen an weitere Unternehmen von Columbia Threadneedle Group übertragen. Die Verwaltungsgesellschaft erhält für ihre Anlageverwaltungsdienste eine monatliche Gebühr zu dem in dieser Erläuterung aufgeführten Jahressatz, ausgedrückt als Prozentsatz des durchschnittlichen täglichen Nettovermögens der einzelnen Portfolios. Die Verwaltungsgesellschaft ist verpflichtet, aus dieser Gebühr die Untervertriebsgebühren zu zahlen. Einige der Unterberater sind verbundene Parteien.

Wie in Erläuterung 8 dargelegt, kann die Verwaltungsgesellschaft auch für alle A-, D-, I- und Z-Anteile des Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolio, für alle J- und Y-Anteile des Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Portfolio und für alle A-, D-, I-, L- und Z-Anteile des Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha Portfolio Performancegebühren erhalten.

Sämtliche durch den Betrieb der SICAV entstandenen und nachstehend definierten Kosten (nachstehend die „Betriebskosten“, „Anlageverwaltungsgebühr“ oder „Portfoliogebühren“, zusammen die „Aufwendungen“) werden zu den in den Tabellen ab Seite 233 aufgeführten Sätzen festgelegt. Alle Aufwendungen fallen auf der Grundlage des Nettoinventarwerts der entsprechenden Anteilklasse im entsprechenden Portfolio täglich an.

Die Betriebskosten beinhalten unter anderem Steuern, Aufwendungen für Rechtsberatungs- und Prüfungsdienste, Druckkosten für Vollmachtsformulare, Aktienzertifikate, Berichte und Mitteilungen an die Anteilinhaber, Verkaufsprospekte und die wesentlichen Informationen für den Anleger (KIID) sowie weitere Werbekosten, Gebühren und Kosten der Verwahrstelle und deren Korrespondenten, der Domizilstelle, Verwaltungsstelle, Register- und Transferstelle sowie der Zahlstelle, Aufwendungen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen, Registrierungsgebühren und Aufwendungen in verschiedenen Rechtsgebieten, Notierungsgebühren, Gebühren für nicht verbundene Verwaltungsratsmitglieder der SICAV, Aufwendungen für die Verwaltungsratsmitglieder und Führungskräfte der SICAV und die Unterberater für deren Teilnahme an Sitzungen des Verwaltungsrates und Versammlungen der Anteilinhaber der SICAV, Übersetzungskosten, Rechnungslegungs- und Kursermittlungskosten (einschließlich der Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil), Versicherung, Rechtsstreitigkeiten und sonstige außerordentliche oder nicht wiederkehrende Aufwendungen und alle sonstigen Aufwendungen, die durch die SICAV ordnungsgemäß zu entrichten sind. In den Betriebskosten ist auch die an die Verwaltungsgesellschaft zahlbare Servicegebühr enthalten. Die Verwaltungsgesellschaft trägt den Teil der Betriebskosten, der über dem Jahressatz liegt. Hingegen ist die Verwaltungsgesellschaft berechtigt, einen Betrag einzubehalten, um den der Jahressatz für Betriebskosten die der SICAV tatsächlich entstandenen Aufwendungen übersteigt.

Darüber hinaus hat die Verwaltungsgesellschaft Anspruch auf eine Anlageverwaltungsgebühr (die „Anlageverwaltungsgebühr“), die in den Tabellen ab Seite 233 näher beschrieben wird und die täglich anfällt und monatlich zahlbar ist. Für die X-Anteile und 4-Anteile wird keine Anlageverwaltungsgebühr fällig. Zur Klarstellung: Die Betriebskosten umfassen weder Anlageverwaltungsgebühren noch Performancegebühren, die hiervon unabhängig sind und gesondert erhoben werden.

Die SICAV bietet B-Anteile für das Threadneedle (Lux) - Global Technology Portfolio an.

Bei diesen B-Anteilen handelt es sich um eine überkommene Anteilklasse, die nur für bestehende Anteilinhaber für weitere Zeichnungen verfügbar ist, und für sie wird kein Ausgabeaufschlag erhoben.

A-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Anleiheportfolios	Max. 3,0 %	Max. 0,75 %
Aktienportfolios und Vermögensallokationsportfolios	Max. 5,0 %	Max. 0,75 %
Absolute-Return-Portfolios	Max. 5,0 %	Max. 0,75 %
Extended-Alpha-Portfolios	Max. 5,0 %	Max. 0,75 %
Specialist-Portfolio	Max. 5,0 %	Max. 0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs- gebühr	Betriebs- kosten	Basis- währung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,60 %	0,20 % ¹	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,60 % ²	0,20 % ³	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	1,25 %	0,20 % ³	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,75 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,40 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,90 %	0,20 % ¹	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,35 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,35 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,30 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,25 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,90 %	0,20 % ¹	USD
Vermögensallokationsportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	1,25 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	1,35 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	1,25 %	0,30 %	USD
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	1,50 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,50 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,50 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	1,50 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	1,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,55 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,30 %	0,20 % ¹	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,50 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,50 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,50 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	1,65 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	1,50 %	0,30 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	1,50 %	0,30 %	GBP
Absolute-Return-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	1,00 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,90 %	0,20 % ³	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	1,50 %	0,35 %	EUR
Extended-Alpha-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	1,50 %	0,30 %	USD
Specialist-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	1,00 %	0,20 % ¹	USD

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

B-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	Nil

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs- gebühr	Betriebs- kosten	Basis- währung
Aktienportfolio				
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	2,00 %	0,35 %	USD

D-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	Max. 1,00 %	Max. 0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs- gebühr	Betriebs- kosten	Basis- währung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	1,35 %	0,20 % ¹	USD
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	1,45 %	0,20 % ¹	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,45 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,45 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,45 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,45 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	1,20 %	0,20 % ¹	USD
Vermögensallokationsportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	2,00 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset income	2,00 %	0,30 %	USD
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	2,25 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	2,25 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	2,00 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,85 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	2,00 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,75 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,50 %	0,20 % ¹	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,85 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	2,40 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	2,00 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	2,25 %	0,35 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	2,25 %	0,30 %	GBP

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs-gebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Absolute-Return-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	1,45 %	0,20 % ³	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	2,00 %	0,35 %	EUR
Extended-Alpha-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	2,00 %	0,30 %	USD
Specialist-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	1,25 %	0,20 % ¹	USD

I-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	Max. 0,75 %

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs-gebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,40 % ⁴	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,40 %	0,10 % ⁶	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,55 % ⁷	0,10 % ⁶	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,40 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,40 %	0,10 % ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,65 %	0,10 % ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,65 %	0,10 % ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,65 %	0,10 % ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,55 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,40 %	0,10 % ⁵	USD
Vermögensallokationsportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,65 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	0,75 %	0,20 %	USD
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	0,65 %	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75 %	0,10 % ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75 %	0,10 % ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75 %	0,10 % ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,70 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,80 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,80 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,25 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,65 %	0,10 % ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,50 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,85 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,20 %	EUR

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs-gebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Aktienportfolios				
<i>(Fortsetzung)</i>				
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,65 %	0,20 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,65 %	0,20 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*	1,25 %	0,35 %	USD
Absolute-Return-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,35 %	0,10 % ⁶	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,75 %	0,20 %	EUR
Extended-Alpha-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,15 %	USD
Specialist-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,80 %	0,10 % ⁵	USD

J-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	Max. 0,75 %

Eine Performancegebühr wird auch für J-Anteile erhoben, wie im Abschnitt „Performancegebühr“ im Hauptteil des Verkaufsprospekts beschrieben.

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs-gebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Absolute-Return-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,25 %	0,10 % ⁶	EUR

L-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	Max. 0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs-gebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Anleiheportfolio				
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30 %	0,10 %	EUR
Vermögensallokationsportfolio				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,50 %	0,20 %	EUR
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	0,35 %	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,50 %	0,20 %	GBP
Absolute-Return-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,20 %	0,10 % ⁶	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,375 %	0,20 %	EUR

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

N-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs- gebühr	Betriebs- kosten	Basis- währung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,30 %	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30 %	0,10 %	EUR
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,55 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,10 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,60 %	0,08 %	GBP
Specialist-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,45 %	0,10 % ⁵	USD

S-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	Max. 5,0 %	Max. 0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs- gebühr	Betriebs- kosten	Basis- währung
Anleiheportfolio				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,50 %	0,20 % ³	USD

T-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	5,00 %	0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs- gebühr	Betriebs- kosten	Basis- währung
Anleiheportfolio				
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,55 %	0,10 %	USD
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,90 %	0,19 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,60 %	0,12 %	GBP

W-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	Max. 5,0 %	Max. 0,75 %

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs- gebühr	Betriebs- kosten	Basis- währung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,00 %	0,20 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,00 %	0,20 % ³	USD
Vermögensallokationsportfolio				
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	1,40 %	0,35 %	USD
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,40 %	0,20 % ⁸	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,15 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,40 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,40 %	0,20 % ⁸	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,55 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,65 %	0,35 %	USD

X-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	Max. 0,75 %

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Betriebskosten	Basis- währung
Anleiheportfolios			
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,10 % ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,10 % ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,10 % ⁵	USD
Aktienportfolios			
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,10 % ⁵	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,10 % ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,15 %	USD
Absolute-Return-Portfolios			
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,10 % ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,15 %	EUR
Specialist-Portfolio			
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,10 % ⁵	USD

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Y-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	5,00 %	Max. 0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs- gebühr	Betriebs- kosten	Basis- währung
Absolute-Return-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,35 %	0,15 % ¹	EUR

Z-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	5,00 %	Max. 0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs- gebühr	Betriebs- kosten	Basis- währung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,40 %	0,15 % ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,40 %	0,15 % ³	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60 %	0,15 % ³	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,40 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,40 %	0,15 % ¹	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,60 %	0,15 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,60 %	0,15 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,60 %	0,15 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,60 %	0,15 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,40 %	0,15 % ¹	USD
Vermögensallokationsportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	0,75 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	0,75 %	0,30 %	USD
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	0,75 %	0,15 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75 %	0,15 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75 %	0,15 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75 %	0,15 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,75 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,75 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,30 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,75 %	0,15 % ¹	EUR

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs-gebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Aktienportfolios				
<i>(Fortsetzung)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,75 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75 %	0,30 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75 %	0,30 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*	1,25 %	0,35 %	USD
Absolute-Return-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,55 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,45 %	0,15 % ¹	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,75 %	0,30 %	EUR
Extended-Alpha-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,30 %	USD
Specialist-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,75 %	0,15 % ¹	USD

1-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	Max. 5,0 %	k. A.

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs-gebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	1,00 %	0,19 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	1,20 %	0,18 %	EUR
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,50 %	0,21 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,50 %	0,18 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,50 %	0,18 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,50 %	0,17 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,50 %	0,17 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,50 %	0,18 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,50 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,30 %	0,23 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,50 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,50 %	0,22 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,50 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,50 %	0,22 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	1,50 %	0,14 %	GBP
Absolute-Return-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	1,00 %	0,17 %	EUR

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs-gebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Extended-Alpha-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	1,50 %	0,19 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	1,50 %	0,19 %	USD

2-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	k. A.

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs-gebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50 %	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,75 %	0,07 %	EUR
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,00 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,00 %	0,07 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,00 %	0,07 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,00 %	0,06 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,00 %	0,06 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,00 %	0,07 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,00 %	0,09 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,00 %	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,00 %	0,09 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,00 %	0,07 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,00 %	0,06 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,00 %	0,07 %	EUR
Absolute-Return-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50 %	0,06 %	EUR
Extended-Alpha-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,08 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,08 %	USD

3-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	Max. 3,0 %	k. A.

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs-gebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50 %	0,19 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60 %	0,17 %	EUR
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75 %	0,18 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	0,75 %	0,13 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75 %	0,12 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75 %	0,18 %	USD

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs- gebühr	Betriebs- kosten	Basis- währung
Aktienportfolios				
<i>(Fortsetzung)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,75 %	0,19 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75 %	0,16 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,13 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75 %	0,18 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75 %	0,12 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75 %	0,13 %	GBP
Extended-Alpha-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,19 %	USD

4-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	k. A.

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Betriebskosten	Basis- währung
Anleiheportfolios			
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,07 %	EUR
Aktienportfolios			
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,09 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,07 %	EUR
Absolute-Return-Portfolio			
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,06 %	EUR

8-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	k. A.

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs- gebühr	Betriebs- kosten	Basis- währung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50 %	0,12 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,75 %	0,11 %	EUR
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,00 %	0,14 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,00 %	0,11 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,00 %	0,11 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,00 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,00 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,00 %	0,11 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,00 %	0,13 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,00 %	0,12 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,00 %	0,13 %	EUR

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs- gebühr	Betriebs- kosten	Basis- währung
Aktienportfolios				
<i>(Fortsetzung)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,00 %	0,11 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,00 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,00 %	0,11 %	EUR
Absolute-Return-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50 %	0,10 %	EUR
Extended-Alpha-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,12 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,12 %	USD

9-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	k. A.

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlageverwaltungs- gebühr	Betriebs- kosten	Basis- währung
Anleiheportfolios				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50 %	0,10 % ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60 %	0,10 % ⁹	EUR
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75 %	0,14 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75 %	0,10 % ¹⁰	USD
	Threadneedle (Lux) - American	0,75 %	0,09 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75 %	0,08 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75 %	0,14 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75 %	0,16 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,75 %	0,10 % ⁵	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75 %	0,16 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75 %	0,12 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,09 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75 %	0,14 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75 %	0,08 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75 %	0,09 %	GBP
Extended-Alpha-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,15 %	USD

*Siehe Erläuterung 1.

¹0,25 % bis 31. Juli 2022.

²0,90 % bis 31. Juli 2022.

³0,30 % bis 31. Juli 2022.

⁴0,50 % bis 31. Juli 2022.

⁵0,15 % bis 31. Juli 2022.

⁶0,20 % bis 31. Juli 2022.

⁷0,65 % bis 31. Juli 2022.

⁸0,35 % bis 31. Juli 2022.

⁹0,13 % bis 31. Juli 2022.

¹⁰0,11 % bis 31. Juli 2022.

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

6 PROVISIONSTEILUNGSVEREINBARUNGEN

Die Verwaltungsgesellschaft und bestimmte Unterberater dürfen Provisionsteilungsvereinbarungen mit Makler-Händlern abschließen. Im Rahmen dieser Vereinbarungen stellen diese Makler-Händler direkt oder über Dritte bestimmte gewerbliche Dienstleistungen bereit, die sie aus den für die Aufträge der SICAV erhaltenen Provisionen bezahlen. Für die bestmögliche Ausführung können Maklerprovisionen für Portfoliotransaktionen der SICAV von der Verwaltungsgesellschaft oder dem jeweiligen Unterberater an Makler-Händler insbesondere für von diesen erbrachte Forschungsleistungen sowie Dienstleistungen im Zusammenhang mit der Ausführung von Bestellungen gewährt werden. Zusätzliche Informationen zu den Praktiken der einzelnen Unterberater in Bezug auf Provisionsteilungsvereinbarungen finden Sie im Abschnitt „Anlageberatungsvereinbarungen“ des Verkaufsprospekts.

Alle von der Verwaltungsgesellschaft oder einem Unterberater eingegangenen Provisionsteilungsvereinbarungen unterliegen den folgenden Bedingungen: (i) die Verwaltungsgesellschaft oder der Unterberater handelt, wenn sie bzw. er Provisionsteilungsvereinbarungen eingeht, jederzeit im besten Interesse der SICAV und ihrer Anteilhaber; (ii) die erbrachten Dienstleistungen stehen in direktem Zusammenhang mit den Aktivitäten der Verwaltungsgesellschaft oder des Unterbauers; (iii) die Verwaltungsgesellschaft oder der Unterberater gewähren Maklerprovisionen für Portfoliotransaktionen der SICAV nur Makler-Händlern, bei denen es sich nicht um natürliche, sondern um juristische Personen handelt; (iv) Vereinbarungen über die Aufteilung von Provisionen sind nicht ausschlaggebend für die Auswahl der Makler-Händler für die Abwicklung; (v) die Verwaltungsgesellschaft oder der Unterberater legen dem Verwaltungsrat einen Bericht über die Vereinbarungen über die Aufteilung von Provisionen vor, aus welchem auch die Art der von ihnen erhaltenen Dienstleistungen hervorgeht; (vi) weder die Verwaltungsgesellschaft, der Unterberater noch eine mit ihnen verbundene Person darf von Makler-Händlern Bargeld oder sonstige Vergünstigungen erhalten; (vii) die erhaltenen Waren oder Dienstleistungen besitzen einen nachweisbaren Nutzen für die Anteilhaber; und (viii) es erfolgt eine regelmäßige Offenlegung im Jahresbericht der SICAV in Form einer Erklärung, in der die jeweiligen Vereinbarungen über die Aufteilung von Provisionen beschrieben sind, einschließlich einer Beschreibung der erhaltenen Waren und Dienstleistungen. Die erhaltenen Waren und Dienstleistungen können Folgendes beinhalten: Analysen, die für den Entscheidungsfindungsprozess des Unterbauers von zusätzlichem Nutzen sein können, und Abwicklungsdienste, die die Möglichkeiten des Unterbauers zur Durchführung von Transaktionen erweitern.

Nur der Unterberater Columbia Management Investment Advisors, LLC darf Provisionsteilungsvereinbarungen abschließen.

7 DIVIDENDEN

Die SICAV hat im Berichtsjahr zum 31. März 2023 die folgenden Dividenden erklärt:

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Klasse AEC	24.06.2022	EUR	0,070	111.727
	Klasse AEC	26.09.2022	EUR	0,080	117.303
	Klasse AEC	22.12.2022	EUR	0,075	121.935
	Klasse AEC	27.03.2023	EUR	0,087	147.580
	Klasse AUP	24.06.2022	USD	0,082	9.754
	Klasse AUP	26.09.2022	USD	0,086	10.591
	Klasse AUP	22.12.2022	USD	0,091	10.285
	Klasse AUP	27.03.2023	USD	0,101	11.643
	Klasse DEC	24.06.2022	EUR	0,064	6.059
	Klasse DEC	26.09.2022	EUR	0,069	6.318
	Klasse DEC	22.12.2022	EUR	0,068	6.810
	Klasse DEC	27.03.2023	EUR	0,079	7.160
	Klasse DUP	24.06.2022	USD	0,074	4.718
	Klasse DUP	26.09.2022	USD	0,079	4.845
	Klasse DUP	22.12.2022	USD	0,081	4.987
	Klasse DUP	27.03.2023	USD	0,091	5.033
	Klasse IEC	24.06.2022	EUR	0,071	26.772
	Klasse IEC	26.09.2022	EUR	0,079	15.785
	Klasse IEC	22.12.2022	EUR	0,073	77.356
	Klasse IEC	27.03.2023	EUR	0,086	110.934
	Klasse IEP	24.06.2022	EUR	0,083	7
	Klasse IEP	26.09.2022	EUR	0,097	7
	Klasse IEP	22.12.2022	EUR	0,092	7
	Klasse IEP	27.03.2023	EUR	0,103	8
	Klasse IGC	24.06.2022	GBP	0,074	98
	Klasse IGC	26.09.2022	GBP	0,085	57
Klasse IGC	22.12.2022	GBP	0,078	58	
Klasse IGC	27.03.2023	GBP	0,089	67	
Klasse IUP	24.06.2022	USD	0,079	43.205	
Klasse IUP	26.09.2022	USD	0,085	44.685	

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond (Fortsetzung)	Klasse IUP	22.12.2022	USD	0,085	25.156
	Klasse IUP	27.03.2023	USD	0,096	26.712
	Klasse NEC	24.06.2022	EUR	0,071	9.821
	Klasse NEC	26.09.2022	EUR	0,079	15.222
	Klasse NEC	22.12.2022	EUR	0,074	27.067
	Klasse NEC	27.03.2023	EUR	0,087	42.919
	Klasse NGC	24.06.2022	GBP	0,073	1.383.354
	Klasse NGC	26.09.2022	GBP	0,083	2.485.421
	Klasse NGC	22.12.2022	GBP	0,076	2.998.447
	Klasse NGC	27.03.2023	GBP	0,088	4.058.889
	Klasse NUP	24.06.2022	USD	0,078	6.297
	Klasse NUP	26.09.2022	USD	0,082	7.210
	Klasse NUP	22.12.2022	USD	0,086	8265
	Klasse NUP	27.03.2023	USD	0,097	11.210
					USD 12.011.784
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	Klasse IEP	24.06.2022	EUR	0,034	3
	Klasse IEP	26.09.2022	EUR	0,039	3
	Klasse IEP	22.12.2022	EUR	0,044	4
	Klasse IEP	27.03.2023	EUR	0,048	25.702
					EUR 25.712
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	Klasse IEP	27.03.2023	EUR	0,351	2.074.526
	Klasse ZEP	27.03.2023	EUR	0,350	42.033
	Klasse 1EP	27.03.2023	EUR	0,343	359.296
	Klasse 1GP	27.03.2023	GBP	0,337	1.333
	Klasse 1UT	25.04.2022	USD	0,029	7.694
	Klasse 1UT	23.05.2022	USD	0,029	7.800
	Klasse 1UT	24.06.2022	USD	0,034	8.798
	Klasse 1UT	25.07.2022	USD	0,031	8.309
	Klasse 1UT	24.08.2022	USD	0,037	6.635
	Klasse 1UT	26.09.2022	USD	0,029	5.351
	Klasse 1UT	25.10.2022	USD	0,032	5.798
	Klasse 1UT	23.11.2022	USD	0,028	4.876
	Klasse 1UT	22.12.2022	USD	0,029	4.893
	Klasse 1UT	25.01.2023	USD	0,032	5.269
	Klasse 1UT	22.02.2023	USD	0,032	3.569
	Klasse 1UT	27.03.2023	USD	0,034	3.765
	Klasse 2EP	27.03.2023	EUR	0,351	1.012
	Klasse 2GP	27.03.2023	GBP	0,340	29
	Klasse 3EP	27.03.2023	EUR	0,355	655.200
	Klasse 3FC	27.03.2023	CHF	0,346	2.285
	Klasse 3GP	27.03.2023	GBP	0,343	23.117
	Klasse 8EP	27.03.2023	EUR	0,352	1.955.544
	Klasse 8GP	27.03.2023	GBP	0,344	1.963
	Klasse 9EP	27.03.2023	EUR	0,355	2.689
	Klasse 9FC	27.03.2023	CHF	0,345	32
	Klasse 9GP	27.03.2023	GBP	0,342	29
					EUR 5.191.845

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	Klasse AEP	27.03.2023	EUR	3,485	1.089
	Klasse IEP	27.03.2023	EUR	3,538	331.231
	Klasse IGC	27.03.2023	GBP	3,616	33
	Klasse XGC	27.03.2023	GBP	3,742	215.386
					EUR 547.739
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	Klasse AEP	24.06.2022	EUR	0,026	1.170
	Klasse AEP	26.09.2022	EUR	0,028	1.269
	Klasse AEP	22.12.2022	EUR	0,030	1.360
	Klasse AEP	27.03.2023	EUR	0,034	1.541
	Klasse ASC	24.06.2022	SGD	0,028	2
	Klasse ASC	26.09.2022	SGD	0,030	2
	Klasse ASC	22.12.2022	SGD	0,034	2
	Klasse ASC	27.03.2023	SGD	0,037	3
	Klasse AUC	24.06.2022	USD	0,027	3
	Klasse AUC	26.09.2022	USD	0,027	3
	Klasse AUC	22.12.2022	USD	0,032	3
	Klasse AUC	27.03.2023	USD	0,035	3
	Klasse IEP	24.06.2022	EUR	0,027	77.800
	Klasse IEP	26.09.2022	EUR	0,030	81.738
	Klasse IEP	22.12.2022	EUR	0,031	84.213
	Klasse IEP	27.03.2023	EUR	0,036	93.226
	Klasse ISC	24.06.2022	SGD	0,028	2
	Klasse ISC	26.09.2022	SGD	0,031	2
	Klasse ISC	22.12.2022	SGD	0,034	2
	Klasse ISC	27.03.2023	SGD	0,037	3
	Klasse IUC	24.06.2022	USD	0,026	2.431
	Klasse IUC	26.09.2022	USD	0,031	2.306
	Klasse IUC	22.12.2022	USD	0,033	2.699
	Klasse IUC	27.03.2023	USD	0,035	2.704
	Klasse NEP	24.06.2022	EUR	2,732	267.909
	Klasse NEP	26.09.2022	EUR	2,817	290.888
	Klasse NEP	22.12.2022	EUR	3,175	309.245
	Klasse NEP	27.03.2023	EUR	3,497	389.704
	Klasse ZEP	24.06.2022	EUR	0,028	16.537
	Klasse ZEP	26.09.2022	EUR	0,029	16.855
	Klasse ZEP	22.12.2022	EUR	0,031	18.017
	Klasse ZEP	27.03.2023	EUR	0,034	19.761
Klasse ZGC	24.06.2022	GBP	0,026	130.082	
Klasse ZGC	26.09.2022	GBP	0,030	165.116	
Klasse ZGC	22.12.2022	GBP	0,033	200.521	
Klasse ZGC	27.03.2023	GBP	0,035	220.183	
					EUR 2.397.305
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Klasse AEP	25.04.2022	EUR	0,033	22.417
	Klasse AEP	23.05.2022	EUR	0,033	22.344
	Klasse AEP	24.06.2022	EUR	0,034	23.102
	Klasse AEP	25.07.2022	EUR	0,034	23.342
	Klasse AEP	24.08.2022	EUR	0,034	23.523
	Klasse AEP	26.09.2022	EUR	0,038	26.906

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond (Fortsetzung)	Klasse AEP	25.10.2022	EUR	0,038	27.088
	Klasse AEP	23.11.2022	EUR	0,038	27.298
	Klasse AEP	22.12.2022	EUR	0,041	30.164
	Klasse AEP	25.01.2023	EUR	0,041	30.321
	Klasse AEP	22.02.2023	EUR	0,041	31.583
	Klasse AEP	27.03.2023	EUR	0,043	32.860
	Klasse DEP	25.04.2022	EUR	0,025	39.717
	Klasse DEP	23.05.2022	EUR	0,025	38.868
	Klasse DEP	24.06.2022	EUR	0,025	38.637
	Klasse DEP	25.07.2022	EUR	0,025	38.247
	Klasse DEP	24.08.2022	EUR	0,025	38.091
	Klasse DEP	26.09.2022	EUR	0,029	44.199
	Klasse DEP	25.10.2022	EUR	0,029	43.716
	Klasse DEP	23.11.2022	EUR	0,029	43.731
	Klasse DEP	22.12.2022	EUR	0,030	45.239
	Klasse DEP	25.01.2023	EUR	0,030	42.143
	Klasse DEP	22.02.2023	EUR	0,030	40.716
	Klasse DEP	27.03.2023	EUR	0,032	42.797
					EUR 817.049
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	Klasse AEC	25.04.2022	EUR	0,037	15.705
	Klasse AEC	23.05.2022	EUR	0,037	15.595
	Klasse AEC	24.06.2022	EUR	0,037	15.700
	Klasse AEC	25.07.2022	EUR	0,037	19.546
	Klasse AEC	24.08.2022	EUR	0,037	19.302
	Klasse AEC	26.09.2022	EUR	0,040	20.385
	Klasse AEC	25.10.2022	EUR	0,040	20.547
	Klasse AEC	23.11.2022	EUR	0,040	21.591
	Klasse AEC	22.12.2022	EUR	0,043	24.320
	Klasse AEC	25.01.2023	EUR	0,043	25.232
	Klasse AEC	22.02.2023	EUR	0,043	24.599
	Klasse AEC	27.03.2023	EUR	0,042	24.282
	Klasse AUP	25.04.2022	USD	0,024	17.340
	Klasse AUP	23.05.2022	USD	0,024	16.918
	Klasse AUP	24.06.2022	USD	0,024	16.852
	Klasse AUP	25.07.2022	USD	0,024	16.725
	Klasse AUP	24.08.2022	USD	0,024	16.576
	Klasse AUP	26.09.2022	USD	0,027	18.566
	Klasse AUP	25.10.2022	USD	0,027	18.638
	Klasse AUP	23.11.2022	USD	0,027	18.610
	Klasse AUP	22.12.2022	USD	0,029	20.155
	Klasse AUP	25.01.2023	USD	0,029	20.038
	Klasse AUP	22.02.2023	USD	0,029	19.622
	Klasse AUP	27.03.2023	USD	0,028	19.561
	Klasse DEC	25.04.2022	EUR	0,027	1.275
	Klasse DEC	23.05.2022	EUR	0,027	1.214
	Klasse DEC	24.06.2022	EUR	0,027	1.218
	Klasse DEC	25.07.2022	EUR	0,027	1.156
	Klasse DEC	24.08.2022	EUR	0,027	1.100

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds (Fortsetzung)	Klasse DEC	26.09.2022	EUR	0,029	1.093
	Klasse DEC	25.10.2022	EUR	0,029	1.315
	Klasse DEC	23.11.2022	EUR	0,029	1.353
	Klasse DEC	22.12.2022	EUR	0,031	1.408
	Klasse DEC	25.01.2023	EUR	0,031	1.442
	Klasse DEC	22.02.2023	EUR	0,031	1.417
	Klasse DEC	27.03.2023	EUR	0,031	1.359
	Klasse IEC	25.04.2022	EUR	0,029	6.065
	Klasse IEC	23.05.2022	EUR	0,029	5.943
	Klasse IEC	24.06.2022	EUR	0,029	5.964
	Klasse IEC	25.07.2022	EUR	0,029	5.758
	Klasse IEC	24.08.2022	EUR	0,029	5.621
	Klasse IEC	26.09.2022	EUR	0,031	6.441
	Klasse IEC	25.10.2022	EUR	0,031	6.560
	Klasse IEC	23.11.2022	EUR	0,031	8.228
	Klasse IEC	22.12.2022	EUR	0,033	9.040
	Klasse IEC	25.01.2023	EUR	0,033	9.262
	Klasse IEC	22.02.2023	EUR	0,033	9.099
	Klasse IEC	27.03.2023	EUR	0,033	9.166
	Klasse XUP	24.06.2022	USD	0,115	10
	Klasse XUP	26.09.2022	USD	0,120	10
	Klasse XUP	22.12.2022	USD	0,129	11
	Klasse XUP	27.03.2023	USD	0,144	12
					USD 568.945
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	Klasse AEC	25.04.2022	EUR	0,032	1.686
	Klasse AEC	23.05.2022	EUR	0,032	1.653
	Klasse AEC	24.06.2022	EUR	0,030	1.526
	Klasse AEC	25.07.2022	EUR	0,030	1.474
	Klasse AEC	24.08.2022	EUR	0,030	1.440
	Klasse AEC	26.09.2022	EUR	0,030	1.400
	Klasse AEC	25.10.2022	EUR	0,030	1.411
	Klasse AEC	23.11.2022	EUR	0,030	1.469
	Klasse AEC	22.12.2022	EUR	0,032	1.618
	Klasse AEC	25.01.2023	EUR	0,032	1.659
	Klasse AEC	22.02.2023	EUR	0,032	1.631
	Klasse AEC	27.03.2023	EUR	0,032	1.603
	Klasse AUP	25.04.2022	USD	0,039	106.883
	Klasse AUP	23.05.2022	USD	0,039	105.977
	Klasse AUP	24.06.2022	USD	0,037	99.530
	Klasse AUP	25.07.2022	USD	0,037	98.705
	Klasse AUP	24.08.2022	USD	0,037	98.021
	Klasse AUP	26.09.2022	USD	0,037	97.393
	Klasse AUP	25.10.2022	USD	0,037	96.612
	Klasse AUP	23.11.2022	USD	0,037	94.403
	Klasse AUP	22.12.2022	USD	0,041	103.601
	Klasse AUP	25.01.2023	USD	0,041	102.393
	Klasse AUP	22.02.2023	USD	0,041	101.873
	Klasse AUP	27.03.2023	USD	0,041	100.793

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt (Fortsetzung)	Klasse SUP	25.04.2022	USD	0,038	1.848
	Klasse SUP	23.05.2022	USD	0,038	1.801
	Klasse SUP	24.06.2022	USD	0,036	1.666
	Klasse SUP	25.07.2022	USD	0,036	1.596
	Klasse SUP	24.08.2022	USD	0,036	1.596
	Klasse SUP	26.09.2022	USD	0,036	1.596
	Klasse SUP	25.10.2022	USD	0,036	1.577
	Klasse SUP	23.11.2022	USD	0,036	1.557
	Klasse SUP	22.12.2022	USD	0,039	1.687
	Klasse SUP	25.01.2023	USD	0,039	1.687
	Klasse SUP	22.02.2023	USD	0,039	1.632
	Klasse SUP	27.03.2023	USD	0,039	1.632
	Klasse XUP	24.06.2022	USD	0,119	11
	Klasse XUP	26.09.2022	USD	0,110	10
	Klasse XUP	22.12.2022	USD	0,115	10
	Klasse XUP	27.03.2023	USD	0,129	11
					USD 1.244.671
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	Klasse AEC	25.04.2022	EUR	0,018	48.010
	Klasse AEC	23.05.2022	EUR	0,018	47.011
	Klasse AEC	24.06.2022	EUR	0,018	47.495
	Klasse AEC	25.07.2022	EUR	0,018	46.495
	Klasse AEC	24.08.2022	EUR	0,018	45.675
	Klasse AEC	26.09.2022	EUR	0,017	42.107
	Klasse AEC	25.10.2022	EUR	0,017	43.247
	Klasse AEC	23.11.2022	EUR	0,017	45.528
	Klasse AEC	22.12.2022	EUR	0,018	50.144
	Klasse AEC	25.01.2023	EUR	0,018	51.773
	Klasse AEC	22.02.2023	EUR	0,018	51.317
	Klasse AEC	27.03.2023	EUR	0,017	48.925
	Klasse ASC	25.04.2022	SGD	0,025	859
	Klasse ASC	23.05.2022	SGD	0,025	860
	Klasse ASC	24.06.2022	SGD	0,025	861
	Klasse ASC	25.07.2022	SGD	0,025	856
	Klasse ASC	24.08.2022	SGD	0,025	856
	Klasse ASC	26.09.2022	SGD	0,024	8.990
	Klasse ASC	25.10.2022	SGD	0,024	8.943
	Klasse ASC	23.11.2022	SGD	0,024	810
	Klasse ASC	22.12.2022	SGD	0,025	720
	Klasse ASC	25.01.2023	SGD	0,025	739
	Klasse ASC	22.02.2023	SGD	0,025	732
	Klasse ASC	27.03.2023	SGD	0,024	693
	Klasse AUP	25.04.2022	USD	0,019	27.434
	Klasse AUP	23.05.2022	USD	0,019	26.923
	Klasse AUP	24.06.2022	USD	0,019	26.758
	Klasse AUP	25.07.2022	USD	0,019	26.268
	Klasse AUP	24.08.2022	USD	0,019	26.190
	Klasse AUP	26.09.2022	USD	0,019	25.973
	Klasse AUP	25.10.2022	USD	0,019	25.872

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds (Fortsetzung)	Klasse AUP	23.11.2022	USD	0,019	25.798
	Klasse AUP	22.12.2022	USD	0,019	25.373
	Klasse AUP	25.01.2023	USD	0,019	25.295
	Klasse AUP	22.02.2023	USD	0,019	25.212
	Klasse AUP	27.03.2023	USD	0,019	24.275
	Klasse XUP	25.04.2022	USD	0,034	12.704
	Klasse XUP	23.05.2022	USD	0,034	12.330
	Klasse XUP	24.06.2022	USD	0,034	12.330
	Klasse XUP	25.07.2022	USD	0,034	12.330
	Klasse XUP	24.08.2022	USD	0,034	12.330
	Klasse XUP	26.09.2022	USD	0,033	11.511
	Klasse XUP	25.10.2022	USD	0,033	11.511
	Klasse XUP	23.11.2022	USD	0,033	11.511
	Klasse XUP	22.12.2022	USD	0,034	11.860
	Klasse XUP	25.01.2023	USD	0,034	11.860
	Klasse XUP	22.02.2023	USD	0,034	11.860
	Klasse XUP	27.03.2023	USD	0,034	6.287
					USD 1.043.441
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	Klasse AEC	25.04.2022	EUR	0,048	1.057
	Klasse AEC	23.05.2022	EUR	0,048	964
	Klasse AEC	24.06.2022	EUR	0,046	927
	Klasse AEC	25.07.2022	EUR	0,046	895
	Klasse AEC	24.08.2022	EUR	0,046	874
	Klasse AEC	26.09.2022	EUR	0,049	702
	Klasse AEC	25.10.2022	EUR	0,049	690
	Klasse AEC	23.11.2022	EUR	0,049	718
	Klasse AEC	22.12.2022	EUR	0,050	757
	Klasse AEC	25.01.2023	EUR	0,050	775
	Klasse AEC	22.02.2023	EUR	0,050	762
	Klasse AEC	27.03.2023	EUR	0,049	725
	Klasse AUP	25.04.2022	USD	0,052	12.890
	Klasse AUP	23.05.2022	USD	0,052	12.725
	Klasse AUP	24.06.2022	USD	0,050	12.233
	Klasse AUP	25.07.2022	USD	0,050	12.005
	Klasse AUP	24.08.2022	USD	0,050	12.015
	Klasse AUP	26.09.2022	USD	0,053	11.574
	Klasse AUP	25.10.2022	USD	0,053	11.456
	Klasse AUP	23.11.2022	USD	0,053	11.462
	Klasse AUP	22.12.2022	USD	0,055	11.642
	Klasse AUP	25.01.2023	USD	0,055	11.645
	Klasse AUP	22.02.2023	USD	0,055	11.581
	Klasse AUP	27.03.2023	USD	0,054	11.362
	Klasse DEC	25.04.2022	EUR	0,036	968
	Klasse DEC	23.05.2022	EUR	0,036	949
	Klasse DEC	24.06.2022	EUR	0,034	899
	Klasse DEC	25.07.2022	EUR	0,034	868
	Klasse DEC	24.08.2022	EUR	0,034	721
	Klasse DEC	26.09.2022	EUR	0,037	763

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond (Fortsetzung)	Klasse DEC	25.10.2022	EUR	0,037	777
	Klasse DEC	23.11.2022	EUR	0,037	437
	Klasse DEC	22.12.2022	EUR	0,037	500
	Klasse DEC	25.01.2023	EUR	0,037	513
	Klasse DEC	22.02.2023	EUR	0,037	504
	Klasse DEC	27.03.2023	EUR	0,037	507
	Klasse IEC	25.04.2022	EUR	0,036	4
	Klasse IEC	23.05.2022	EUR	0,036	4
	Klasse IEC	24.06.2022	EUR	0,034	3
	Klasse IEC	25.07.2022	EUR	0,034	3
	Klasse IEC	24.08.2022	EUR	0,034	3
	Klasse IEC	26.09.2022	EUR	0,036	3
	Klasse IEC	25.10.2022	EUR	0,036	3
	Klasse IEC	23.11.2022	EUR	0,036	3
	Klasse IEC	22.12.2022	EUR	0,037	4
	Klasse IEC	25.01.2023	EUR	0,037	4
	Klasse IEC	22.02.2023	EUR	0,037	4
	Klasse IEC	27.03.2023	EUR	0,036	4
	Klasse ISC	25.04.2022	SGD	0,039	5.316
	Klasse ISC	23.05.2022	SGD	0,039	5.589
	Klasse ISC	24.06.2022	SGD	0,037	5.613
	Klasse ISC	25.07.2022	SGD	0,037	5.888
	Klasse ISC	24.08.2022	SGD	0,037	6.411
	Klasse ISC	26.09.2022	SGD	0,040	7.178
	Klasse ISC	25.10.2022	SGD	0,040	7.170
	Klasse ISC	23.11.2022	SGD	0,040	8.052
	Klasse ISC	22.12.2022	SGD	0,041	9.803
	Klasse ISC	25.01.2023	SGD	0,041	10.496
	Klasse ISC	22.02.2023	SGD	0,041	10.764
	Klasse ISC	27.03.2023	SGD	0,040	11.478
	Klasse XUP	24.06.2022	USD	0,137	12
	Klasse XUP	26.09.2022	USD	0,141	13
	Klasse XUP	22.12.2022	USD	0,138	12
	Klasse XUP	27.03.2023	USD	0,153	14
					USD 254.693
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	Klasse ASC	25.04.2022	SGD	0,031	97
	Klasse ASC	23.05.2022	SGD	0,031	96
	Klasse ASC	24.06.2022	SGD	0,031	98
	Klasse ASC	25.07.2022	SGD	0,031	98
	Klasse ASC	24.08.2022	SGD	0,031	101
	Klasse ASC	26.09.2022	SGD	0,031	101
	Klasse ASC	25.10.2022	SGD	0,031	101
	Klasse ASC	23.11.2022	SGD	0,031	109
	Klasse ASC	22.12.2022	SGD	0,031	114
	Klasse ASC	25.01.2023	SGD	0,031	120
	Klasse ASC	22.02.2023	SGD	0,031	121
	Klasse ASC	27.03.2023	SGD	0,030	120
	Klasse AUP	25.04.2022	USD	0,032	22.341
	Klasse AUP	23.05.2022	USD	0,032	21.537

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond (Fortsetzung)	Klasse AUP	24.06.2022	USD	0,032	21.560
	Klasse AUP	25.07.2022	USD	0,032	21.630
	Klasse AUP	24.08.2022	USD	0,032	20.285
	Klasse AUP	26.09.2022	USD	0,033	20.982
	Klasse AUP	25.10.2022	USD	0,033	19.486
	Klasse AUP	23.11.2022	USD	0,033	19.559
	Klasse AUP	22.12.2022	USD	0,033	20.162
	Klasse AUP	25.01.2023	USD	0,033	20.230
	Klasse AUP	22.02.2023	USD	0,033	19.400
	Klasse AUP	27.03.2023	USD	0,031	16.128
	Klasse AVC	25.04.2022	AUD	0,029	2
	Klasse AVC	23.05.2022	AUD	0,029	2
	Klasse AVC	24.06.2022	AUD	0,029	2
	Klasse AVC	25.07.2022	AUD	0,029	2
	Klasse AVC	24.08.2022	AUD	0,029	2
	Klasse AVC	26.09.2022	AUD	0,030	2
	Klasse AVC	25.10.2022	AUD	0,030	2
	Klasse AVC	23.11.2022	AUD	0,030	2
	Klasse AVC	22.12.2022	AUD	0,030	2
	Klasse AVC	25.01.2023	AUD	0,030	2
	Klasse AVC	22.02.2023	AUD	0,030	2
	Klasse AVC	27.03.2023	AUD	0,028	2
	Klasse ZUP	25.04.2022	USD	0,031	3
	Klasse ZUP	23.05.2022	USD	0,031	3
	Klasse ZUP	24.06.2022	USD	0,031	3
	Klasse ZUP	25.07.2022	USD	0,031	3
	Klasse ZUP	24.08.2022	USD	0,031	3
	Klasse ZUP	26.09.2022	USD	0,032	3
	Klasse ZUP	25.10.2022	USD	0,032	3
	Klasse ZUP	23.11.2022	USD	0,032	3
	Klasse ZUP	22.12.2022	USD	0,032	3
	Klasse ZUP	25.01.2023	USD	0,032	3
	Klasse ZUP	22.02.2023	USD	0,032	3
	Klasse ZUP	27.03.2023	USD	0,030	3
					USD 244.636
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	Klasse AEP	26.09.2022	EUR	0,006	0*
	Klasse IEP	26.09.2022	EUR	0,006	0*
	Klasse LEP	26.09.2022	EUR	0,006	1
	Klasse ZEP	26.09.2022	EUR	0,006	1
					EUR 2
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Klasse AEC	25.04.2022	EUR	0,011	730
	Klasse AEC	23.05.2022	EUR	0,011	723
	Klasse AEC	24.06.2022	EUR	0,015	990
	Klasse AEC	25.07.2022	EUR	0,015	956
	Klasse AEC	24.08.2022	EUR	0,015	934
	Klasse AEC	26.09.2022	EUR	0,014	848
	Klasse AEC	25.10.2022	EUR	0,014	849
	Klasse AEC	23.11.2022	EUR	0,014	884

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return (Fortsetzung)	Klasse AEC	22.12.2022	EUR	0,017	1.108
	Klasse AEC	25.01.2023	EUR	0,017	1.137
	Klasse AEC	22.02.2023	EUR	0,017	1.116
	Klasse AEC	27.03.2023	EUR	0,019	1.257
	Klasse AUP	25.04.2022	USD	0,013	4.142
	Klasse AUP	23.05.2022	USD	0,013	4.075
	Klasse AUP	24.06.2022	USD	0,018	5.637
	Klasse AUP	25.07.2022	USD	0,018	5.620
	Klasse AUP	24.08.2022	USD	0,018	5.623
	Klasse AUP	26.09.2022	USD	0,017	5.316
	Klasse AUP	25.10.2022	USD	0,017	5.189
	Klasse AUP	23.11.2022	USD	0,017	5.173
	Klasse AUP	22.12.2022	USD	0,020	5.808
	Klasse AUP	25.01.2023	USD	0,020	5.790
	Klasse AUP	22.02.2023	USD	0,020	5.634
	Klasse AUP	27.03.2023	USD	0,024	6.664
					USD 76.203
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Klasse AEC	24.06.2022	EUR	0,069	313.033
	Klasse AEC	26.09.2022	EUR	0,066	266.392
	Klasse AEC	22.12.2022	EUR	0,086	379.727
	Klasse AEC	27.03.2023	EUR	0,085	384.430
	Klasse AEP	24.06.2022	EUR	0,089	180.810
	Klasse AEP	26.09.2022	EUR	0,093	179.618
	Klasse AEP	22.12.2022	EUR	0,112	250.815
	Klasse AEP	27.03.2023	EUR	0,110	261.451
	Klasse ASC	24.06.2022	SGD	0,082	1.139
	Klasse ASC	26.09.2022	SGD	0,079	988
	Klasse ASC	22.12.2022	SGD	0,103	1.395
	Klasse ASC	27.03.2023	SGD	0,102	1.218
	Klasse ASP	24.06.2022	SGD	0,084	332
	Klasse ASP	26.09.2022	SGD	0,083	309
	Klasse ASP	22.12.2022	SGD	0,103	406
	Klasse ASP	27.03.2023	SGD	0,102	407
	Klasse AUM	25.04.2022	USD	0,032	1.307
	Klasse AUM	23.05.2022	USD	0,032	1.307
	Klasse AUM	24.06.2022	USD	0,029	1.184
	Klasse AUM	25.07.2022	USD	0,029	1.184
	Klasse AUM	24.08.2022	USD	0,029	1.184
	Klasse AUM	26.09.2022	USD	0,028	1.143
	Klasse AUM	25.10.2022	USD	0,028	1.143
	Klasse AUM	23.11.2022	USD	0,028	1.143
	Klasse AUM	22.12.2022	USD	0,037	1.511
	Klasse AUM	25.01.2023	USD	0,037	1.511
	Klasse AUM	22.02.2023	USD	0,037	1.511
	Klasse AUM	27.03.2023	USD	0,036	1.470
	Klasse AUP	24.06.2022	USD	0,083	85.009
	Klasse AUP	26.09.2022	USD	0,079	80.027
	Klasse AUP	22.12.2022	USD	0,104	101.164
	Klasse AUP	27.03.2023	USD	0,104	97.805

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income (Fortsetzung)	Klasse DEC	24.06.2022	EUR	0,066	181.028
	Klasse DEC	26.09.2022	EUR	0,062	148.914
	Klasse DEC	22.12.2022	EUR	0,081	205.327
	Klasse DEC	27.03.2023	EUR	0,080	193.628
	Klasse DEP	24.06.2022	EUR	0,083	24.637
	Klasse DEP	26.09.2022	EUR	0,087	23.603
	Klasse DEP	22.12.2022	EUR	0,104	28.433
	Klasse DEP	27.03.2023	EUR	0,102	25.210
	Klasse DUP	24.06.2022	USD	0,075	116.300
	Klasse DUP	26.09.2022	USD	0,072	99.959
	Klasse DUP	22.12.2022	USD	0,094	79.868
	Klasse DUP	27.03.2023	USD	0,094	64.141
	Klasse ZEC	24.06.2022	EUR	0,077	8
	Klasse ZEC	26.09.2022	EUR	0,073	7
	Klasse ZEC	22.12.2022	EUR	0,096	9
	Klasse ZEC	27.03.2023	EUR	0,095	10
	Klasse ZUP	24.06.2022	USD	0,083	8
	Klasse ZUP	26.09.2022	USD	0,080	8
	Klasse ZUP	22.12.2022	USD	0,105	11
	Klasse ZUP	27.03.2023	USD	0,105	11
					USD 3.793.193
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	Klasse AEC	26.09.2022	EUR	0,090	9
	Klasse AUP	26.09.2022	USD	0,085	7
	Klasse ZEC	26.09.2022	EUR	0,091	9
	Klasse ZUP	26.09.2022	USD	0,086	8
	Klasse AEC	27.03.2023	EUR	0,061	7
	Klasse AUP	27.03.2023	USD	0,065	7
	Klasse ZEC	27.03.2023	EUR	0,062	7
	Klasse ZUP	27.03.2023	USD	0,066	7
					USD 61
Threadneedle (Lux) - Global Focus	Klasse AEP	26.09.2022	EUR	0,136	479.250
	Klasse AUP	26.09.2022	USD	0,092	3.669
	Klasse IUP	26.09.2022	USD	0,094	4.737
	Klasse ZEP	26.09.2022	EUR	0,141	495.188
	Klasse AEP	27.03.2023	EUR	0,117	506.043
	Klasse AUP	27.03.2023	USD	0,087	2.983
	Klasse IUP	27.03.2023	USD	0,090	4.588
	Klasse ZEP	27.03.2023	EUR	0,121	487.443
					USD 1.983.901
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	Klasse AEC	24.06.2022	EUR	0,099	506
	Klasse AEC	26.09.2022	EUR	0,074	347
	Klasse AEC	22.12.2022	EUR	0,047	16
	Klasse AEC	27.03.2023	EUR	0,068	24
	Klasse AUP	24.06.2022	USD	0,106	9
	Klasse AUP	26.09.2022	USD	0,075	6
	Klasse AUP	22.12.2022	USD	0,053	4
	Klasse AUP	27.03.2023	USD	0,076	6

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income (Fortsetzung)	Klasse DEC	24.06.2022	EUR	0,097	8
	Klasse DEC	26.09.2022	EUR	0,072	5
	Klasse DEC	22.12.2022	EUR	0,046	4
	Klasse DEC	27.03.2023	EUR	0,066	5
	Klasse DUP	24.06.2022	USD	0,104	5.127
	Klasse DUP	26.09.2022	USD	0,075	3.697
	Klasse DUP	22.12.2022	USD	0,053	2.613
	Klasse DUP	27.03.2023	USD	0,075	3.697
	Klasse 1EP	24.06.2022	EUR	0,116	178.563
	Klasse 1EP	26.09.2022	EUR	0,090	128.169
	Klasse 1EP	22.12.2022	EUR	0,060	91.837
	Klasse 1EP	27.03.2023	EUR	0,083	127.226
	Klasse 1SC	24.06.2022	SGD	0,104	33.653
	Klasse 1SC	26.09.2022	SGD	0,076	24.001
	Klasse 1SC	22.12.2022	SGD	0,052	16.975
	Klasse 1SC	27.03.2023	SGD	0,074	24.070
	Klasse 1ST	25.04.2022	SGD	0,021	888
	Klasse 1ST	23.05.2022	SGD	0,038	1.586
	Klasse 1ST	24.06.2022	SGD	0,044	1.831
	Klasse 1ST	25.07.2022	SGD	0,013	775
	Klasse 1ST	24.08.2022	SGD	0,027	1.601
	Klasse 1ST	26.09.2022	SGD	0,030	1.725
	Klasse 1ST	25.10.2022	SGD	0,014	821
	Klasse 1ST	23.11.2022	SGD	0,015	916
	Klasse 1ST	22.12.2022	SGD	0,023	1.395
	Klasse 1ST	25.01.2023	SGD	0,021	1.274
	Klasse 1ST	22.02.2023	SGD	0,017	1.020
	Klasse 1ST	27.03.2023	SGD	0,036	2.183
	Klasse 1UP	24.06.2022	USD	0,107	43.826
	Klasse 1UP	26.09.2022	USD	0,077	31.317
	Klasse 1UP	22.12.2022	USD	0,055	22.193
	Klasse 1UP	27.03.2023	USD	0,078	30.902
	Klasse 1VT	25.04.2022	AUD	0,021	125
	Klasse 1VT	23.05.2022	AUD	0,037	213
	Klasse 1VT	24.06.2022	AUD	0,043	245
	Klasse 1VT	25.07.2022	AUD	0,018	103
	Klasse 1VT	24.08.2022	AUD	0,025	154
	Klasse 1VT	26.09.2022	AUD	0,029	168
	Klasse 1VT	25.10.2022	AUD	0,014	78
	Klasse 1VT	23.11.2022	AUD	0,014	83
	Klasse 1VT	22.12.2022	AUD	0,022	131
	Klasse 1VT	25.01.2023	AUD	0,019	119
	Klasse 1VT	22.02.2023	AUD	0,016	98
	Klasse 1VT	27.03.2023	AUD	0,035	134
	Klasse 2EP	24.06.2022	EUR	0,118	9
	Klasse 2EP	26.09.2022	EUR	0,092	6
	Klasse 2EP	22.12.2022	EUR	0,060	5
	Klasse 2EP	27.03.2023	EUR	0,083	6
	Klasse 2UP	24.06.2022	USD	0,109	9

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income (Fortsetzung)	Klasse 2UP	26.09.2022	USD	0,078	6
	Klasse 2UP	22.12.2022	USD	0,055	5
	Klasse 2UP	27.03.2023	USD	0,079	6
	Klasse 3EP	24.06.2022	EUR	0,118	1.044.736
	Klasse 3EP	26.09.2022	EUR	0,093	650.582
	Klasse 3EP	22.12.2022	EUR	0,061	466.789
	Klasse 3EP	27.03.2023	EUR	0,084	651.468
	Klasse 3UP	24.06.2022	USD	0,110	4.337
	Klasse 3UP	26.09.2022	USD	0,079	1.592
	Klasse 3UP	22.12.2022	USD	0,056	1.129
	Klasse 3UP	27.03.2023	USD	0,080	1.613
	Klasse 8EP	24.06.2022	EUR	0,118	30
	Klasse 8EP	26.09.2022	EUR	0,092	21
	Klasse 8EP	22.12.2022	EUR	0,060	15
	Klasse 8EP	27.03.2023	EUR	0,084	21
	Klasse 8UP	24.06.2022	USD	0,109	6.320
	Klasse 8UP	26.09.2022	USD	0,078	4.523
	Klasse 8UP	22.12.2022	USD	0,056	3.247
	Klasse 8UP	27.03.2023	USD	0,079	8.333
	Klasse 9EP	24.06.2022	EUR	0,119	9
	Klasse 9EP	26.09.2022	EUR	0,093	7
	Klasse 9EP	22.12.2022	EUR	0,060	5
	Klasse 9EP	27.03.2023	EUR	0,084	7
	Klasse 9UP	24.06.2022	USD	0,110	9
	Klasse 9UP	26.09.2022	USD	0,079	6
	Klasse 9UP	22.12.2022	USD	0,056	5
	Klasse 9UP	27.03.2023	USD	0,079	6
					USD 3.631.334
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	Klasse AEP	27.03.2023	EUR	0,124	2.831.822
	Klasse AUP	27.03.2023	USD	0,113	7.187
	Klasse IEP	27.03.2023	EUR	0,106	269.229
					EUR 3.108.238
Threadneedle (Lux) - American	Klasse 1EP	27.03.2023	EUR	0,226	75.664
					USD 75.664
Threadneedle (Lux) - American Select	Klasse 1EP	27.03.2023	EUR	0,083	34.680
					USD 34.680
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	Klasse 1EP	27.03.2023	EUR	0,220	265.086
					USD 265.086
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	Klasse XUP	26.09.2022	USD	0,185	473.152
	Klasse XUP	27.03.2023	USD	0,106	271.103
					USD 744.255

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung der Anteilkategorie	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilkategorie)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	Klasse AEC	26.09.2022	EUR	0,123	6
	Klasse AUP	26.09.2022	USD	0,129	1.189
	Klasse AEC	27.03.2023	EUR	0,108	6
	Klasse AUP	27.03.2023	USD	0,131	1.165
					USD 2.366
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	Klasse AUP	26.09.2022	USD	0,125	8
	Klasse IEC	26.09.2022	EUR	0,121	7
	Klasse AUP	27.03.2023	USD	0,135	9
	Klasse IEC	27.03.2023	EUR	0,117	7
					USD 31
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	Klasse 1EP	27.03.2023	EUR	0,368	24
	Klasse 1GP	27.03.2023	GBP	0,360	24
	Klasse 3GP	27.03.2023	GBP	0,371	161
	Klasse 9GP	27.03.2023	GBP	0,373	24
					EUR 233
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	Klasse 1EP	26.09.2022	EUR	0,035	371.038
	Klasse 1EP	27.03.2023	EUR	0,011	114.499
	Klasse 1GP	26.09.2022	GBP	0,031	11.429
	Klasse 1GP	27.03.2023	GBP	0,010	3.736
	Klasse 2EP	26.09.2022	EUR	0,356	26
	Klasse 2EP	27.03.2023	EUR	0,113	8
	Klasse 2GP	26.09.2022	GBP	0,359	25
	Klasse 2GP	27.03.2023	GBP	0,113	8
	Klasse 3EP	26.09.2022	EUR	0,056	3.990
	Klasse 3EP	27.03.2023	EUR	0,018	1.283
	Klasse 3GP	26.09.2022	GBP	0,050	34.197
	Klasse 3GP	27.03.2023	GBP	0,016	11.108
	Klasse 4GP	26.09.2022	GBP	0,046	267.760
	Klasse 4GP	27.03.2023	GBP	0,014	116.916
	Klasse 8EP	26.09.2022	EUR	0,037	31.847
	Klasse 8EP	27.03.2023	EUR	0,012	10.329
	Klasse 8GP	26.09.2022	GBP	0,033	16.998
	Klasse 8GP	27.03.2023	GBP	0,010	5.389
	Klasse 9EP	26.09.2022	EUR	0,357	25
	Klasse 9EP	27.03.2023	EUR	0,114	8
	Klasse 9GP	26.09.2022	GBP	0,362	26
	Klasse 9GP	27.03.2023	GBP	0,114	34
	Klasse AEP	26.09.2022	EUR	0,346	11.866
	Klasse AEP	27.03.2023	EUR	0,109	4.174
Klasse AUP	26.09.2022	USD	0,305	25	
Klasse AUP	27.03.2023	USD	0,107	8	
Klasse DEP	26.09.2022	EUR	0,341	5.875	
Klasse DEP	27.03.2023	EUR	0,107	1.863	
Klasse IEP	26.09.2022	EUR	0,357	307.207	
Klasse IEP	27.03.2023	EUR	0,114	74.498	

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend (Fortsetzung)	Klasse ZEP	26.09.2022	EUR	0,355	8.095
	Klasse ZEP	27.03.2023	EUR	0,113	2.577
					EUR 1.416.867
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	Klasse 1EP	27.03.2023	EUR	0,186	126.015
	Klasse 3EP	27.03.2023	EUR	0,192	180.310
	Klasse 3GP	27.03.2023	GBP	0,187	30.570
	Klasse 9EP	27.03.2023	EUR	0,192	12
	Klasse 9GP	27.03.2023	GBP	0,188	12
					EUR 336.919
Threadneedle (Lux) - European Select	Klasse 1EP	27.03.2023	EUR	0,213	194.688
	Klasse 2EP	27.03.2023	EUR	0,221	13
	Klasse 8EP	27.03.2023	EUR	0,221	5.790
					EUR 200.491
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	Klasse 1EP	27.03.2023	EUR	0,226	781.099
	Klasse 3EP	27.03.2023	EUR	0,233	18.966
	Klasse 9EP	27.03.2023	EUR	0,233	129.402
					EUR 929.467
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	Klasse AUP	26.09.2022	USD	0,286	45.163
	Klasse AUP	27.03.2023	USD	0,168	31.295
	Klasse DUP	26.09.2022	USD	0,278	16.296
	Klasse DUP	27.03.2023	USD	0,163	4.483
	Klasse IEP	26.09.2022	EUR	0,342	348.469
	Klasse IEP	27.03.2023	EUR	0,180	205.943
	Klasse XUP	26.09.2022	USD	0,302	75.948
	Klasse XUP	27.03.2023	USD	0,178	48.022
	Klasse ZGP	26.09.2022	GBP	0,313	19
	Klasse ZGP	27.03.2023	GBP	0,163	11
	Klasse ZUP	26.09.2022	USD	0,334	1.227
	Klasse ZUP	27.03.2023	USD	0,197	743
Threadneedle (Lux) - Global Technology	Klasse AUP	27.03.2023	USD	0,145	10.451
					USD 10.451
Threadneedle (Lux) - UK Equities	Klasse AGP	26.09.2022	GBP	0,383	16.731
	Klasse AGP	27.03.2023	GBP	0,197	5.892
	Klasse IGP	26.09.2022	GBP	0,567	338.830
	Klasse IGP	27.03.2023	GBP	0,293	65.024
	Klasse NGP	26.09.2022	GBP	0,227	13
	Klasse NGP	27.03.2023	GBP	0,116	7
	Klasse TGP	26.09.2022	GBP	0,227	13
	Klasse TGP	27.03.2023	GBP	0,116	7
	Klasse ZGP	26.09.2022	GBP	0,204	265.325
Klasse ZGP	27.03.2023	GBP	0,105	12.195	

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - UK Equities (Fortsetzung)	Klasse 9EP	26.09.2022	EUR	0,179	412.664
	Klasse 9EP	27.03.2023	EUR	0,093	211.997
					GBP 1.328.698
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	Klasse AEC	24.06.2022	EUR	0,117	5.839
	Klasse AEC	26.09.2022	EUR	0,081	4.000
	Klasse AEC	22.12.2022	EUR	0,089	3.617
	Klasse AEC	27.03.2023	EUR	0,059	2.346
	Klasse ASC	24.06.2022	SGD	0,122	10
	Klasse ASC	26.09.2022	SGD	0,080	7
	Klasse ASC	22.12.2022	SGD	0,095	8
	Klasse ASC	27.03.2023	SGD	0,062	5
	Klasse AUC	24.06.2022	USD	0,127	56.110
	Klasse AUC	26.09.2022	USD	0,082	39.960
	Klasse AUC	22.12.2022	USD	0,105	41.605
	Klasse AUC	27.03.2023	USD	0,066	9.790
	Klasse DEC	24.06.2022	EUR	0,112	1.228
	Klasse DEC	26.09.2022	EUR	0,074	839
	Klasse DEC	22.12.2022	EUR	0,084	938
	Klasse DEC	27.03.2023	EUR	0,055	617
	Klasse DGP	24.06.2022	GBP	0,125	101
	Klasse DGP	26.09.2022	GBP	0,085	69
	Klasse DGP	22.12.2022	GBP	0,094	76
	Klasse DGP	27.03.2023	GBP	0,061	49
	Klasse IGP	24.06.2022	GBP	0,133	180.846
	Klasse IGP	26.09.2022	GBP	0,089	125.937
	Klasse IGP	22.12.2022	GBP	0,100	149.178
	Klasse IGP	27.03.2023	GBP	0,065	103.841
	Klasse LGP	24.06.2022	GBP	0,134	1.576.236
	Klasse LGP	26.09.2022	GBP	0,091	1.098.940
	Klasse LGP	22.12.2022	GBP	0,102	1.249.139
Klasse LGP	27.03.2023	GBP	0,067	808.633	
Klasse ZGP	24.06.2022	GBP	0,138	17.245	
Klasse ZGP	26.09.2022	GBP	0,092	15.120	
Klasse ZGP	22.12.2022	GBP	0,104	10.586	
Klasse ZGP	27.03.2023	GBP	0,069	6.662	
					GBP 5.509.577
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Klasse 1EP	27.03.2023	EUR	0,377	20.237
	Klasse 2EP	27.03.2023	EUR	0,385	104.683
	Klasse 2GC	27.03.2023	GBP	0,397	34
	Klasse 8EP	27.03.2023	EUR	0,385	47.983
	Klasse 8GC	27.03.2023	GBP	0,407	577
					EUR 173.514
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Klasse IEP	24.06.2022	EUR	0,086	8
	Klasse IEP	26.09.2022	EUR	0,078	7
	Klasse IEP	22.12.2022	EUR	0,081	7
	Klasse IEP	27.03.2023	EUR	0,074	7

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities					
<i>(Fortsetzung)</i>	Klasse LEP	24.06.2022	EUR	0,087	7
	Klasse LEP	26.09.2022	EUR	0,078	7
	Klasse LEP	22.12.2022	EUR	0,082	7
	Klasse LEP	27.03.2023	EUR	0,075	7
					EUR 57
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Klasse AEP	27.03.2023	EUR	0,195	5.516
					EUR 5.516

*Bruchteilsbetrag auf 0 gerundet.

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

8 PERFORMANCEGEBÜHREN

Die Verwaltungsgesellschaft erhält in Bezug auf die Anteilklassen der in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Portfolios eine Performancegebühr. Für die Performancegebühr werden tägliche Rückstellungen im Hinblick auf den Saldo der Performancegebühr gebildet (wie nachstehend beschrieben), wobei der aufgelaufene Betrag am Ende jedes Kalenderjahres (d. h. am 31. Dezember) an die Verwaltungsgesellschaft ausbezahlt wird. Die Verwaltungsgesellschaft ist für die Zahlung der gesamten oder eines Teils der Performancegebühr an die Unterberater gemäß deren Unterberatungsvertrag verantwortlich. Die Höhe dieser Performancegebühr hängt von der Wertentwicklung des Nettoinventarwertes (NIW) der betreffenden Anteilklasse innerhalb des betreffenden Portfolios im Vergleich zu der Wertentwicklung des jeweiligen Performance-Index ab (der „Performance-Index“, wie in der nachstehenden Tabelle aufgeführt). Der Performance-Index unterliegt einer Mindestrendite, um sicherzustellen, dass die Portfolios eine positive Mindestrendite erzielen müssen, damit eine Performance-Gebühr gezahlt wird, falls die zugrunde liegende Benchmarkrendite negativ ist. Es laufen nur dann Gebühren auf, wenn der Saldo der Performancegebühr positiv ist und die NIW High Water Mark (wie nachstehend definiert) überschritten wird.

Der Performance-Referenzzeitraum jeder Anteilklasse ist die gesamte Laufzeit der Anteilklasse, d. h. von ihrer Auflegung bis zur Auflösung.

Die Wertentwicklung der Anteilklassen wird unter Berücksichtigung gezahlter Ausschüttungen ermittelt.

Portfolio	Anteilklassen	Performance-Index	Performance-Satz
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	A-Anteile D-Anteile I-Anteile Z-Anteile	Der höhere Wert aus der 90-tägigen Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR) zzgl. 1,75 %, jedoch mindestens 1,50 %	20 %
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	J-Anteile Y-Anteile	Der höhere Wert aus dem kumulierten €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat zzgl. 1,00 %, jedoch mindestens 1,00 %	10 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	A-Anteile D-Anteile I-Anteile L-Anteile Z-Anteile	Der höhere Wert aus dem 3-monatigen Euro Interbank Offered Rate (EURIBOR) ¹ zzgl. 1,50 %, jedoch mindestens 1,50 %	20 %

¹ Die Benchmark wird von ICE Benchmark Administration Limited bereitgestellt, einem Administrator, der im ESMA-Register der Benchmark-Administratoren eingetragen ist. Die Verwaltungsgesellschaft unterhält einen schriftlichen Plan, in dem die Maßnahmen festgelegt sind, die im Falle einer wesentlichen Änderung oder Einstellung der Benchmark ergriffen werden.

Die Wertentwicklung des Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolio, des Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Portfolio und des Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha Portfolio, einschließlich der Auswirkungen aller maßgeblichen Gebühren, wird mit dem Performance-Index verglichen.

NIW High Water Mark: Bezüglich der einzelnen Anteilklassen entspricht der Nettoinventarwert eines Anteils dieser Anteilklasse dem des letzten Bewertungstichtags des letzten relevanten Kalenderjahres, in dem eine eventuell aufgelaufene Performancegebühr bezahlt wurde. Wurde noch nie eine Performancegebühr gezahlt, entspricht die NIW High Water Mark dem Anfangspreis der jeweiligen Anteilklasse. Die NIW High Water Mark kann nur erhöht und unter keinen Umständen verringert werden.

Der Saldo der Performancegebühr wird basierend auf der Differenz zwischen der Wertentwicklung des Performance-Index und der Wertentwicklung der betreffenden Anteilklasse berechnet (die „Tagesdifferenz“):

- (i) Wenn die Tagesdifferenz positiv ist, steigt der Saldo der Performancegebühr um einen Betrag, der sich nach der Tagesdifferenz richtet und anhand des Performance-Gebührensatzes bestimmt wird;
- (ii) Ist die Tagesdifferenz negativ, verringert sich der Saldo der Performancegebühr um einen Betrag, der sich nach der Tagesdifferenz richtet und anhand des Performance-Gebührensatzes bestimmt wird.

Ist der Saldo der Performancegebühr am Ende des Kalenderjahres, d. h. am 31. Dezember, positiv und wurde die NIW High Water Mark überschritten, so wird der aufgelaufene Betrag der Performancegebühr innerhalb des ersten Quartals des folgenden Kalenderjahres an die Verwaltungsgesellschaft gezahlt. Eine Performancegebühr wird an die Verwaltungsgesellschaft nur in dem Fall gezahlt, in dem der Nettoinventarwert der betreffenden Anteilklasse über der NIW High Water Mark liegt und der Saldo der Performancegebühr positiv ist.

Wenn am Ende des Kalenderjahres der Saldo der Performancegebühr negativ ist und die NIW High Water Mark nicht überschritten wurde, wird dieser negative Betrag vorgetragen und die Verwaltungsgesellschaft erhält so lange keine Performancegebühr, bis die aufgelaufene Performancegebühr am Ende eines nachfolgenden Kalenderjahres wieder positiv ausfällt und die NIW High Water Mark überschritten wurde.

Wenn am Ende des Kalenderjahres der Saldo der Performancegebühr negativ ist und die NIW High Water Mark überschritten wurde, wird dieser negative Betrag vorgetragen und die Verwaltungsgesellschaft erhält so lange keine Performancegebühr, bis der Saldo der aufgelaufenen Performancegebühr am Ende eines nachfolgenden Kalenderjahres wieder positiv ausfällt und die NIW High Water Mark überschritten wurde.

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

8 PERFORMANCEGEBÜHREN

(Fortsetzung)

Falls ein Portfolio oder eine Anteilklasse liquidiert oder ein Portfolio oder eine Anteilklasse inaktiv werden, werden noch ausstehende, aufgelaufene Performancegebühren abgerechnet und an die Verwaltungsgesellschaft zahlbar. Investieren im Anschluss daran neue Anteilhaber in ein solches Portfolio oder eine solche Anteilklasse, wird der Saldo der Performancegebühr zurückgesetzt.

Die Performancegebühr ist nicht begrenzt.

Für das Berichtsjahr zum 31. März 2023 wurden keine Performancegebühren gezahlt.

9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

Zum 31. März 2023 hatte die SICAV die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	6.984	USD	7.485	Absicherung	JP Morgan Chase New York	111
19.04.2023	GBP	180.185	USD	221.968	Absicherung	JP Morgan Chase New York	909
19.04.2023	GBP	287.799	USD	354.537	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.452
19.04.2023	GBP	61	USD	75	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	1.096.517	USD	1.350.791	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.530
19.04.2023	GBP	17.712	USD	21.667	Absicherung	JP Morgan Chase New York	241
19.04.2023	GBP	795.037	USD	963.534	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19.876
19.04.2023	GBP	4.239	USD	5.186	Absicherung	JP Morgan Chase New York	58
19.04.2023	GBP	316.884	USD	387.646	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.319
19.04.2023	GBP	226.800	USD	279.701	Absicherung	JP Morgan Chase New York	836
19.04.2023	GBP	1.005.551	USD	1.233.174	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10.629
19.04.2023	EUR	13.840	USD	14.955	Absicherung	JP Morgan Chase New York	97
19.04.2023	EUR	13.395	USD	14.284	Absicherung	JP Morgan Chase New York	285
19.04.2023	EUR	322	USD	343	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
19.04.2023	EUR	12.415	USD	13.305	Absicherung	JP Morgan Chase New York	197
19.04.2023	GBP	3.847.317	USD	4.682.045	Absicherung	JP Morgan Chase New York	76.840
19.04.2023	EUR	113.222	USD	121.344	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.797
19.04.2023	EUR	44.471	USD	47.661	Absicherung	JP Morgan Chase New York	706
19.04.2023	EUR	3.990	USD	4.211	Absicherung	JP Morgan Chase New York	129
19.04.2023	GBP	26.080.232	USD	31.734.713	Absicherung	JP Morgan Chase New York	524.865
19.04.2023	EUR	109.434	USD	117.511	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.509
19.04.2023	EUR	8	USD	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	299.600	USD	324.935	Absicherung	JP Morgan Chase New York	911
19.04.2023	EUR	27.893	USD	30.252	Absicherung	JP Morgan Chase New York	85
19.04.2023	CHF	8	USD	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	CHF	8	USD	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	2.990	USD	3.181	Absicherung	JP Morgan Chase New York	71
19.04.2023	EUR	135.774	USD	145.514	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.155
19.04.2023	EUR	151.422	USD	162.284	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.403
19.04.2023	EUR	22.675	USD	24.301	Absicherung	JP Morgan Chase New York	360
19.04.2023	EUR	22.179	USD	24.044	Absicherung	JP Morgan Chase New York	78
19.04.2023	EUR	186.881	USD	200.287	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.966
19.04.2023	EUR	16.832.911	USD	18.107.216	Absicherung	JP Morgan Chase New York	200.291
19.04.2023	EUR	458.158	USD	491.024	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7.271
19.04.2023	EUR	40.630.500	USD	43.706.359	Absicherung	JP Morgan Chase New York	483.454
19.04.2023	EUR	26.015	USD	27.454	Absicherung	JP Morgan Chase New York	840
19.04.2023	EUR	1.100.118	USD	1.183.401	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13.090
19.04.2023	EUR	75.000.000	USD	80.953.905	Absicherung	JP Morgan Chase New York	616.245
19.04.2023	EUR	87	USD	94	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	105.903	USD	115.483	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(303)
19.04.2023	EUR	15	USD	16	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	14.897	USD	15.847	Absicherung	JP Morgan Chase New York	354
19.04.2023	EUR	40.446	USD	43.584	Absicherung	JP Morgan Chase New York	405
19.04.2023	EUR	4.380	USD	4.751	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
19.04.2023	CHF	768	USD	845	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
19.04.2023	EUR	10.086.292	USD	10.849.856	Absicherung	JP Morgan Chase New York	120.015
19.04.2023	EUR	1.281	USD	1.399	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
19.04.2023	NOK	82	USD	8	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	NOK	82	USD	8	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	14.339	USD	15.398	Absicherung	JP Morgan Chase New York	198
19.04.2023	SEK	96.500	USD	9.089	Absicherung	JP Morgan Chase New York	227
19.04.2023	GBP	3.595	USD	4.375	Absicherung	JP Morgan Chase New York	72
19.04.2023	EUR	12.273.737	USD	13.202.898	Absicherung	JP Morgan Chase New York	146.043
19.04.2023	EUR	13.694.081	USD	14.730.767	Absicherung	JP Morgan Chase New York	162.943
19.04.2023	SEK	7.163	USD	679	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
19.04.2023	EUR	2.129.877	USD	2.291.116	Absicherung	JP Morgan Chase New York	25.343
19.04.2023	GBP	320.401	USD	395.134	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.182
19.04.2023	EUR	4.990	USD	5.392	Absicherung	JP Morgan Chase New York	35
19.04.2023	EUR	24.406	USD	26.372	Absicherung	JP Morgan Chase New York	172
19.04.2023	GBP	31.606	USD	38.675	Absicherung	JP Morgan Chase New York	420
19.04.2023	EUR	501	USD	541	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	GBP	1.068.039	USD	1.303.173	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17.923
19.04.2023	EUR	49.869	USD	54.061	Absicherung	JP Morgan Chase New York	176
19.04.2023	EUR	209.287	USD	226.881	Absicherung	JP Morgan Chase New York	741
19.04.2023	EUR	2.990	USD	3.213	Absicherung	JP Morgan Chase New York	39
19.04.2023	GBP	731.745	USD	889.436	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15.686
19.04.2023	GBP	321.159.349	USD	390.790.228	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.463.333
19.04.2023	GBP	538.066	USD	660.644	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.909
19.04.2023	USD	25.864	EUR	24.313	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(577)
19.04.2023	GBP	1.181.631	USD	1.456.680	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.922
19.04.2023	GBP	1.179	USD	1.460	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
19.04.2023	GBP	5.528	USD	6.727	Absicherung	JP Morgan Chase New York	111
19.04.2023	EUR	3.934.074	USD	4.231.895	Absicherung	JP Morgan Chase New York	46.811
19.04.2023	EUR	707	USD	761	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
19.04.2023	GBP	751.955	USD	914.980	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15.139
19.04.2023	GBP	98.663.213	USD	120.054.483	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.985.597
19.04.2023	NOK	7.248	USD	690	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
19.04.2023	NOK	7.291	USD	694	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
19.04.2023	GBP	64.847	USD	79.854	Absicherung	JP Morgan Chase New York	358
19.04.2023	GBP	298.090	USD	369.179	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(460)
19.04.2023	GBP	983.139	USD	1.203.025	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13.055
19.04.2023	GBP	16.432.095	USD	19.994.754	Absicherung	JP Morgan Chase New York	330.696
19.04.2023	SEK	8.468.579	USD	802.214	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15.351
19.04.2023	GBP	302.464	USD	368.041	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.087
19.04.2023	GBP	118.283	USD	142.399	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.910
19.04.2023	GBP	870.282	USD	1.047.719	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28.765
19.04.2023	GBP	791.575	USD	961.547	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17.580
19.04.2023	SEK	81	USD	8	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	657.237	USD	706.992	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7.820
19.04.2023	USD	7.391	EUR	6.821	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(28)
19.04.2023	CHF	766	USD	844	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
19.04.2023	EUR	2.304.000	USD	2.486.904	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18.931
19.04.2023	USD	4.058	GBP	3.316	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
19.04.2023	USD	24.845	EUR	22.784	Absicherung	JP Morgan Chase New York	65
19.04.2023	USD	27.869	EUR	25.837	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(231)
19.04.2023	USD	11.486	GBP	9.413	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(158)
19.04.2023	USD	172	EUR	159	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	USD	30.067	EUR	28.000	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(386)
19.04.2023	USD	41.054	GBP	33.289	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(123)
19.04.2023	USD	41.770	EUR	39.580	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.276)
19.04.2023	USD	9.942	GBP	8.064	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(34)
19.04.2023	USD	87	GBP	71	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	44.986	GBP	37.367	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.235)
19.04.2023	USD	33.968	GBP	27.963	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(621)
19.04.2023	USD	622	EUR	578	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
19.04.2023	USD	58.087	EUR	54.000	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(643)
19.04.2023	USD	485	EUR	451	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
19.04.2023	USD	15.839	GBP	13.069	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(327)
19.04.2023	USD	257	EUR	238	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
19.04.2023	USD	147.868	EUR	136.472	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(558)
19.04.2023	USD	15.098	EUR	13.824	Absicherung	JP Morgan Chase New York	64
19.04.2023	USD	111	EUR	103	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	USD	236.247	GBP	191.565	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(706)
19.04.2023	USD	240.327	EUR	225.377	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.788)
19.04.2023	USD	1.218	EUR	1.154	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(37)
19.04.2023	USD	3.261	EUR	3.037	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
19.04.2023	USD	274.992	GBP	223.312	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.231)
19.04.2023	USD	320.918	GBP	260.607	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.436)
19.04.2023	USD	86.659	GBP	70.296	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(293)
19.04.2023	USD	130	EUR	121	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
19.04.2023	USD	2.506	GBP	2.061	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
19.04.2023	USD	24.153	GBP	19.672	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(179)
05.04.2023	USD	52.168	JPY	6.881.139	Handel	JP Morgan	430
05.04.2023	USD	9.811	AUD	14.627	Handel	JP Morgan	13
05.04.2023	USD	30.798	JPY	4.036.927	Handel	Goldman Sachs	445
05.04.2023	USD	221.637	CAD	303.145	Handel	JP Morgan	(2.373)
05.04.2023	USD	7.177	AUD	10.792	Handel	JP Morgan	(52)
05.04.2023	USD	1.394.010	GBP	1.135.120	Handel	Citigroup Global Markets	(9.643)
05.04.2023	USD	764.112	EUR	710.310	Handel	JP Morgan	(7.799)
05.04.2023	JPY	4.572.392	USD	34.097	Handel	JP Morgan	282
05.04.2023	JPY	4.040.268	USD	31.190	Handel	Goldman Sachs	(813)
05.04.2023	USD	593.192	GBP	485.420	Handel	JP Morgan	(7.062)
05.04.2023	USD	1.461.904	EUR	1.356.779	Handel	Goldman Sachs	(12.540)
05.04.2023	GBP	1.129.280	USD	1.394.500	Handel	Citigroup Global Markets	1.933
05.04.2023	USD	2.432	AUD	3.644	Handel	JP Morgan	(9)
05.04.2023	USD	2.141.312	EUR	1.975.420	Handel	Barclays	(5.427)
05.04.2023	USD	216.795	EUR	200.000	Handel	Citigroup Global Markets	(550)

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
05.04.2023	USD	593.525	EUR	554.410	Handel	JP Morgan	(8.964)
05.04.2023	JPY	4.263.392	USD	32.317	Handel	JP Morgan	(261)
05.04.2023	USD	173.923	CAD	238.261	Handel	JP Morgan	(2.141)
05.04.2023	USD	5.509.708	EUR	5.209.140	Handel	JP Morgan	(151.161)
05.04.2023	USD	233.462	CAD	320.853	Handel	JP Morgan	(3.634)
05.04.2023	USD	21.347.734	EUR	19.720.000	Handel	Barclays	(82.482)
05.04.2023	USD	11.706	AUD	17.624	Handel	JP Morgan	(100)
05.04.2023	USD	14.835	AUD	22.196	Handel	JP Morgan	(33)
05.04.2023	USD	163.792	EUR	150.000	Handel	Barclays	783
05.04.2023	USD	179.319.822	EUR	168.916.094	Handel	JP Morgan	(4.244.610)
05.04.2023	USD	248.700	EUR	235.190	Handel	JP Morgan	(6.886)
05.04.2023	USD	676.171	EUR	628.750	Handel	Barclays	(7.107)
05.04.2023	USD	7.129	AUD	10.708	Handel	JP Morgan	(44)
05.04.2023	USD	6.577	AUD	9.856	Handel	JP Morgan	(25)
05.04.2023	USD	65.227.254	GBP	54.637.542	Handel	JP Morgan	(2.335.612)
05.04.2023	USD	8.019.588	CAD	10.922.399	Handel	JP Morgan	(51.570)
05.04.2023	USD	1.444	AUD	2.156	Handel	Citigroup Global Markets	0
05.04.2023	JPY	2.764.716	USD	21.079	Handel	JP Morgan	(292)
05.04.2023	JPY	8.265.002	USD	62.237	Handel	JP Morgan	(95)
05.04.2023	USD	12.174	AUD	18.222	Handel	JP Morgan	(32)
05.04.2023	CAD	122.598	USD	89.488	Handel	Citigroup Global Markets	1.107
05.04.2023	USD	7.287	AUD	11.031	Handel	JP Morgan	(102)
05.04.2023	USD	720.863	CAD	985.000	Handel	JP Morgan	(7.008)
05.04.2023	EUR	1.806.260	USD	1.914.370	Handel	Citigroup Global Markets	48.539
05.04.2023	USD	18.981	JPY	2.588.984	Handel	Goldman Sachs	(484)
05.04.2023	AUD	25.093	USD	16.870	Handel	Goldman Sachs	(61)
05.04.2023	AUD	171.397	USD	115.305	Handel	JP Morgan	(493)
05.04.2023	AUD	8.526	USD	5.709	Handel	JP Morgan	2
05.04.2023	EUR	1.275.745	USD	1.370.985	Handel	JP Morgan	15.401
05.04.2023	EUR	1.057.617	USD	1.144.877	Handel	Citigroup Global Markets	4.464
05.04.2023	AUD	15.094	USD	10.063	Handel	JP Morgan	48
05.04.2023	AUD	5.413	USD	3.650	Handel	Citigroup Global Markets	(25)
05.04.2023	USD	45.873	JPY	6.086.880	Handel	JP Morgan	107
05.04.2023	AUD	10.707	USD	7.250	Handel	JP Morgan	(78)
05.04.2023	USD	242.476	EUR	228.580	Handel	Barclays	(5.926)
05.04.2023	CAD	208.089	USD	151.981	Handel	JP Morgan	1.788
05.04.2023	CAD	69.337	USD	50.893	Handel	JP Morgan	344
05.04.2023	EUR	1.300.000	USD	1.412.683	Handel	JP Morgan	61
05.04.2023	CAD	100.662	USD	73.644	Handel	JP Morgan	741
05.04.2023	EUR	1.656.590	USD	1.778.020	Handel	JP Morgan	22.240
05.04.2023	CAD	97.076	USD	71.353	Handel	JP Morgan	381
05.04.2023	CAD	232.274	USD	169.577	Handel	JP Morgan	2.063
05.04.2023	CAD	317.889	USD	232.638	Handel	JP Morgan	2.268
05.04.2023	AUD	8.255	USD	5.466	Handel	JP Morgan	63
05.04.2023	USD	6.648.320	GBP	5.400.000	Handel	Barclays	(29.150)
05.04.2023	USD	3.137.320	GBP	2.534.230	Handel	Barclays	3.570
05.04.2023	USD	2.875.127	JPY	391.796.323	Handel	Citigroup Global Markets	(70.625)
05.04.2023	USD	348.467	JPY	45.600.000	Handel	Goldman Sachs	5.610
05.04.2023	JPY	5.625.897	USD	41.535	Handel	JP Morgan	764

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
05.04.2023	USD	182.408	CAD	247.967	Handel	Goldman Sachs	(828)
05.04.2023	CAD	68.427	USD	50.463	Handel	JP Morgan	101
05.04.2023	USD	46.329	CAD	63.727	Handel	JP Morgan	(762)
05.04.2023	USD	761.372	EUR	721.010	Handel	JP Morgan	(22.162)
05.04.2023	USD	716.123	GBP	581.390	Handel	Citigroup Global Markets	(2.806)
05.04.2023	USD	6.084	AUD	9.146	Handel	JP Morgan	(42)
05.04.2023	JPY	5.362.561	USD	40.436	Handel	JP Morgan	(117)
05.04.2023	USD	78.240	CAD	107.897	Handel	JP Morgan	(1.491)
05.04.2023	JPY	11.556.083	USD	87.088	Handel	JP Morgan	(201)
05.04.2023	USD	301.581	CAD	414.173	Handel	JP Morgan	(4.473)
05.04.2023	USD	4.840	AUD	7.226	Handel	JP Morgan	0
05.04.2023	USD	1.417	AUD	2.133	Handel	JP Morgan	(11)
05.04.2023	USD	1.549.865	EUR	1.458.348	Handel	JP Morgan	(34.950)
05.04.2023	USD	84.263	CAD	115.881	Handel	JP Morgan	(1.368)
05.04.2023	USD	2.929	AUD	4.442	Handel	JP Morgan	(47)
05.04.2023	USD	113.441	CAD	156.902	Handel	JP Morgan	(2.503)
05.04.2023	USD	1.416.321	EUR	1.320.703	Handel	Citigroup Global Markets	(18.917)
05.04.2023	USD	246.037	EUR	231.840	Handel	JP Morgan	(5.908)
04.04.2023	GBP	581.390	USD	716.110	Handel	Citigroup Global Markets	2.801
03.04.2023	EUR	1.975.420	USD	2.141.089	Handel	Barclays	5.379
							USD 4.390.217

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
04.05.2023	EUR	4.022.426	GBP	3.537.901	Handel	Lloyds	980
04.05.2023	EUR	8.588.282	USD	9.362.361	Handel	Lloyds	(12.537)
04.05.2023	EUR	198.777	GBP	175.000	Handel	NatWest Markets	(141)
19.04.2023	CHF	785	EUR	803	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
19.04.2023	NOK	85	EUR	8	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	NOK	84	EUR	7	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	643	EUR	727	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	USD	903	EUR	839	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
19.04.2023	NOK	7.532	EUR	667	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
19.04.2023	USD	14	EUR	13	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	NOK	7.464	EUR	661	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
19.04.2023	CHF	10	EUR	10	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	CHF	10	EUR	10	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	CHF	795	EUR	814	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
19.04.2023	GBP	9	EUR	11	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
04.04.2023	EUR	48.432	USD	51.503	Handel	JP Morgan	1.036
04.04.2023	EUR	4.103.796	GBP	3.637.901	Handel	Lloyds	(35.880)
04.04.2023	EUR	9.057.564	USD	9.693.260	Handel	NatWest Markets	137.333
04.04.2023	USD	47.052	EUR	43.783	Handel	JP Morgan	(483)
04.04.2023	USD	300.000	EUR	282.624	Handel	JP Morgan	(6.548)
04.04.2023	USD	51.790	EUR	48.266	Handel	Lloyds	(606)
04.04.2023	GBP	100.000	EUR	113.868	Handel	Barclays	(75)

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
04.04.2023	USD	48.802	EUR	45.323	Handel	Lloyds	(413)
04.04.2023	EUR	59.896	USD	65.242	Handel	JP Morgan	(143)
							EUR 82.484

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	USD	1.088.802	EUR	1.012.177	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11.074)
19.04.2023	EUR	3.040	CHF	2.995	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
19.04.2023	EUR	614	CHF	604	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	EUR	3.532	CHF	3.479	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23
19.04.2023	CHF	56.611	EUR	57.947	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(854)
19.04.2023	CHF	280.555	EUR	287.176	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.231)
19.04.2023	CHF	68.503	EUR	70.120	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.033)
19.04.2023	EUR	744	CHF	733	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	CHF	813	EUR	832	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
19.04.2023	EUR	8	NOK	96	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	11	NOK	120	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	7	SEK	79	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	10	SEK	112	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	31	CHF	31	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	2.198	CHF	2.178	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	CHF	837	EUR	857	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
19.04.2023	EUR	9	CHF	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	CHF	324.296	EUR	331.950	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.891)
19.04.2023	EUR	11.928	USD	12.783	Absicherung	JP Morgan Chase New York	174
19.04.2023	SEK	7.700	EUR	678	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	SEK	7.776	EUR	685	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	SEK	88	EUR	8	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	12.473	EUR	11.423	Absicherung	JP Morgan Chase New York	46
19.04.2023	EUR	11.537	USD	12.387	Absicherung	JP Morgan Chase New York	148
19.04.2023	EUR	9	NOK	102	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	9	CHF	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	NOK	7.799	EUR	690	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
19.04.2023	NOK	88	EUR	8	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	NOK	86	EUR	8	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	NOK	7.985	EUR	707	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
05.04.2023	USD	26.534	EUR	24.739	Handel	NatWest Markets	(323)
05.04.2023	USD	41.630	EUR	38.880	Handel	NatWest Markets	(572)
05.04.2023	USD	21.851	EUR	20.647	Handel	Goldman Sachs	(539)
05.04.2023	USD	24.692	EUR	23.279	Handel	JP Morgan	(558)
05.04.2023	USD	18.709	EUR	17.374	Handel	Lloyds	(158)
05.04.2023	USD	26.850	EUR	24.934	Handel	JP Morgan	(226)
05.04.2023	EUR	402.553	GBP	353.677	Handel	JP Morgan	109
05.04.2023	USD	67.490	EUR	63.522	Handel	Lloyds	(1.418)
05.04.2023	EUR	34.286	USD	37.115	Handel	JP Morgan	133
05.04.2023	EUR	34.145	USD	36.640	Handel	Lloyds	429

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
05.04.2023	EUR	42.357	USD	46.017	Handel	Citigroup Global Markets	13
05.04.2023	EUR	27.342	USD	29.202	Handel	Barclays	471
05.04.2023	EUR	53.399	USD	57.634	Handel	JP Morgan	364
05.04.2023	EUR	6.342.132	USD	6.732.321	Handel	JP Morgan	147.120
05.04.2023	GBP	462.384	EUR	527.095	Handel	NatWest Markets	(955)
05.04.2023	GBP	162.898	EUR	184.746	Handel	JP Morgan	614
05.04.2023	GBP	213.781	EUR	243.350	Handel	Lloyds	(92)
05.04.2023	GBP	140.079	EUR	159.157	Handel	JP Morgan	237
05.04.2023	GBP	146.053	EUR	165.133	Handel	NatWest Markets	1.058
05.04.2023	EUR	16.859	USD	17.962	Handel	NatWest Markets	330
05.04.2023	EUR	2.275.864	GBP	2.000.000	Handel	Barclays	96
05.04.2023	EUR	160.800	GBP	142.953	Handel	JP Morgan	(1.864)
05.04.2023	EUR	49.791.028	GBP	44.270.288	Handel	JP Morgan	(583.518)
05.04.2023	EUR	1.969.780	GBP	1.750.000	Handel	NatWest Markets	(21.520)
05.04.2023	EUR	31.942	USD	33.969	Handel	JP Morgan	684
							EUR (481.773)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	29	GBP	26	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	10	SEK	109	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	10	NOK	113	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	70.440	GBP	61.973	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
19.04.2023	GBP	4.960.998	EUR	5.612.029	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30.139
19.04.2023	NOK	8.608	EUR	762	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
19.04.2023	EUR	163.134	GBP	143.255	Absicherung	JP Morgan Chase New York	209
19.04.2023	SEK	8.475	EUR	746	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
19.04.2023	GBP	21.270.535	EUR	24.061.865	Absicherung	JP Morgan Chase New York	129.221
19.04.2023	GBP	767	EUR	868	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	GBP	737	EUR	834	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	NOK	8.616	EUR	763	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
19.04.2023	EUR	10	SEK	109	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	1.291.096	GBP	1.140.110	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.560)
19.04.2023	EUR	38.255	GBP	33.642	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
19.04.2023	NOK	101	EUR	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SEK	103	EUR	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	NOK	102	EUR	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SEK	8.402	EUR	740	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
19.04.2023	GBP	8	EUR	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	235.224	EUR	267.187	Absicherung	JP Morgan Chase New York	334
19.04.2023	SEK	100	EUR	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	10	NOK	115	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
05.04.2023	GBP	32.746	EUR	37.276	Handel	Barclays	(15)
05.04.2023	USD	1.177	EUR	1.093	Handel	JP Morgan	(10)
05.04.2023	USD	1.490	EUR	1.408	Handel	Goldman Sachs	(37)
05.04.2023	EUR	988	USD	1.074	Handel	Citigroup Global Markets	0

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
05.04.2023	EUR	1.789	USD	1.903	Handel	JP Morgan	38
05.04.2023	USD	1.932	EUR	1.819	Handel	JP Morgan	(41)
05.04.2023	GBP	25.040	EUR	28.450	Handel	JP Morgan	42
05.04.2023	GBP	48.514	EUR	55.020	Handel	JP Morgan	183
05.04.2023	GBP	61.270	EUR	69.844	Handel	JP Morgan	(125)
05.04.2023	EUR	2.855	USD	3.062	Handel	Barclays	37
05.04.2023	EUR	1.298	USD	1.401	Handel	JP Morgan	9
05.04.2023	EUR	29.766	GBP	26.384	Handel	Barclays	(257)
05.04.2023	EUR	42.946	GBP	37.732	Handel	JP Morgan	12
05.04.2023	EUR	383.654	USD	407.292	Handel	JP Morgan	8.868
05.04.2023	EUR	1.811	USD	1.934	Handel	Barclays	31
05.04.2023	EUR	29.647	GBP	26.357	Handel	JP Morgan	(344)
05.04.2023	USD	1.369	EUR	1.276	Handel	JP Morgan	(16)
05.04.2023	EUR	31.248	GBP	27.500	Handel	Barclays	(44)
05.04.2023	EUR	1.967	USD	2.132	Handel	JP Morgan	6
05.04.2023	EUR	11.009.697	GBP	9.788.741	Handel	JP Morgan	(128.776)
05.04.2023	GBP	311.990	EUR	354.398	Handel	JP Morgan	611
							EUR 34.475

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - European Social Bond die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	SGD	869	EUR	600	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	CHF	30.491	EUR	31.211	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(460)
19.04.2023	GBP	7.403.441	EUR	8.374.994	Absicherung	JP Morgan Chase New York	44.977
19.04.2023	CHF	20.126	EUR	20.603	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(305)
19.04.2023	CHF	352.210	EUR	361.503	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.291)
19.04.2023	CHF	454	EUR	466	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
19.04.2023	GBP	23.967	EUR	27.141	Absicherung	JP Morgan Chase New York	117
19.04.2023	GBP	423.728	EUR	482.702	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(794)
19.04.2023	GBP	8.191	EUR	9.265	Absicherung	JP Morgan Chase New York	50
19.04.2023	CHF	4.567	EUR	4.590	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
19.04.2023	GBP	7.333	EUR	8.374	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(35)
19.04.2023	GBP	5.836	EUR	6.657	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
19.04.2023	EUR	3.869	GBP	3.420	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21)
19.04.2023	EUR	233.627	GBP	206.534	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.266)
19.04.2023	EUR	20.983	GBP	18.446	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	GBP	11.941	EUR	13.621	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(41)
19.04.2023	GBP	3.460	EUR	3.914	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21
19.04.2023	SEK	7.339	EUR	646	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	NOK	7.464	EUR	661	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
19.04.2023	GBP	48.314.537	EUR	54.654.849	Absicherung	JP Morgan Chase New York	293.515
19.04.2023	SGD	852	EUR	589	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	GBP	633	EUR	716	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	GBP	1.079	EUR	1.225	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	GBP	1.004	EUR	1.137	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	CHF	23.625.309	EUR	24.182.924	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(356.302)

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	GBP	15.125	EUR	17.182	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21
19.04.2023	GBP	778.736	EUR	887.142	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.482)
19.04.2023	CHF	73.838	EUR	74.335	Absicherung	JP Morgan Chase New York	132
19.04.2023	USD	14.242	EUR	13.240	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(145)
19.04.2023	USD	876	EUR	814	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
19.04.2023	USD	711.340	EUR	661.279	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7.235)
19.04.2023	USD	144	EUR	135	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
19.04.2023	USD	874	EUR	813	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
19.04.2023	SGD	871	EUR	602	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	CHF	773	EUR	791	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
19.04.2023	SEK	7.328	EUR	645	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	CHF	11	EUR	12	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	927	GBP	816	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	117	GBP	103	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	4.778	GBP	4.194	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
19.04.2023	EUR	14.874	GBP	13.103	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(27)
19.04.2023	SGD	841	EUR	581	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	EUR	14.904	GBP	13.083	Absicherung	JP Morgan Chase New York	25
19.04.2023	EUR	324	GBP	286	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	GBP	29.425	EUR	33.265	Absicherung	JP Morgan Chase New York	200
19.04.2023	GBP	1.134	EUR	1.290	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	NOK	7.460	EUR	660	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
19.04.2023	USD	855	EUR	794	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
19.04.2023	SGD	14	EUR	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
17.04.2023	EUR	723.976	CAD	1.054.875	Handel	HSBC	7.051
17.04.2023	EUR	8.706	CAD	12.729	Handel	HSBC	55
17.04.2023	GBP	200.000	EUR	228.292	Handel	HSBC	(815)
17.04.2023	EUR	11.542.489	USD	12.200.972	Handel	HSBC	323.294
17.04.2023	EUR	478.168	SEK	5.347.693	Handel	Citigroup Global Markets	3.482
17.04.2023	EUR	22.342.750	GBP	19.586.586	Handel	HSBC	65.260
17.04.2023	USD	200.000	EUR	188.276	Handel	HSBC	(4.364)
17.04.2023	CAD	5.832	EUR	3.993	Handel	HSBC	(29)
							EUR 358.560

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	14	USD	15	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	307	USD	329	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	USD	20.768	EUR	19.306	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(211)
19.04.2023	EUR	12	SEK	136	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	917	EUR	853	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
19.04.2023	SEK	7.772	EUR	684	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	NOK	7.886	EUR	698	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
19.04.2023	NOK	7.978	EUR	706	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
19.04.2023	EUR	12	NOK	140	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	12	NOK	140	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
18.04.2023	USD	289.873	EUR	271.558	Handel	Citigroup Global Markets	(5.018)
18.04.2023	EUR	492.473	USD	526.959	Handel	HSBC	7.940
18.04.2023	EUR	17.655.716	USD	18.994.404	Handel	Barclays	190.447
18.04.2023	EUR	143.763	USD	155.888	Handel	JP Morgan	423
18.04.2023	EUR	48.906	USD	52.200	Handel	HSBC	909
18.04.2023	EUR	49.117	JPY	6.987.374	Handel	HSBC	702
18.04.2023	EUR	65.125	GBP	57.543	Handel	Lloyds	(321)
18.04.2023	EUR	21.276.019	GBP	18.924.417	Handel	HSBC	(247.747)
18.04.2023	JPY	24.803.747	EUR	172.596	Handel	HSBC	(738)
18.04.2023	EUR	120.155	GBP	105.955	Handel	NatWest Markets	(353)
18.04.2023	USD	326.448	EUR	303.776	Handel	HSBC	(3.605)
18.04.2023	USD	215.610	EUR	201.696	Handel	NatWest Markets	(3.441)
18.04.2023	USD	341.658	EUR	322.783	Handel	NatWest Markets	(8.626)
18.04.2023	GBP	88.640	EUR	100.532	Handel	JP Morgan	282
18.04.2023	GBP	2.408.755	EUR	2.744.204	Handel	NatWest Markets	(4.616)
18.04.2023	JPY	37.821.542	EUR	271.670	Handel	HSBC	(9.615)
18.04.2023	GBP	125.026	EUR	143.064	Handel	JP Morgan	(866)
18.04.2023	EUR	165.848	GBP	147.698	Handel	Lloyds	(2.137)
18.04.2023	EUR	112.969	AUD	175.664	Handel	NatWest Markets	4.720
							EUR (81.880)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	USD	6.200	EUR	5.686	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16
19.04.2023	USD	9.695	EUR	8.939	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(27)
19.04.2023	USD	3.708	EUR	3.447	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(41)
19.04.2023	USD	1.077	EUR	999	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
19.04.2023	USD	10.824	EUR	10.028	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(82)
19.04.2023	USD	16.004	EUR	15.008	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(319)
19.04.2023	SEK	7.279	USD	690	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
19.04.2023	SGD	100.463	USD	74.638	Absicherung	JP Morgan Chase New York	969
19.04.2023	EUR	981	USD	1.063	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
19.04.2023	EUR	518	USD	559	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	EUR	3.198	USD	3.402	Absicherung	JP Morgan Chase New York	76
19.04.2023	EUR	21.865	USD	23.561	Absicherung	JP Morgan Chase New York	219
19.04.2023	NOK	7.358	USD	701	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
19.04.2023	EUR	4.727.870	USD	5.085.785	Absicherung	JP Morgan Chase New York	56.256
19.04.2023	EUR	55.000	USD	59.623	Absicherung	JP Morgan Chase New York	195
19.04.2023	USD	12.258	EUR	11.522	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(274)
19.04.2023	EUR	245	USD	263	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
19.04.2023	EUR	5.477.394	USD	5.892.051	Absicherung	JP Morgan Chase New York	65.174
19.04.2023	EUR	137.446	USD	147.851	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.635
19.04.2023	EUR	305.305	USD	328.418	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.633
19.04.2023	EUR	173	USD	182	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
19.04.2023	EUR	2.039.008	USD	2.193.367	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24.262
19.04.2023	EUR	11.304.599	USD	12.160.393	Absicherung	JP Morgan Chase New York	134.511

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	2.007.745	USD	2.159.737	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23.890
19.04.2023	EUR	9.000	USD	9.714	Absicherung	JP Morgan Chase New York	74
19.04.2023	EUR	7.328	USD	8.004	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(34)
19.04.2023	EUR	4	USD	4	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	9.000	USD	9.597	Absicherung	JP Morgan Chase New York	191
19.04.2023	USD	12.820	EUR	11.918	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(142)
19.04.2023	USD	3.081	EUR	2.864	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(34)
19.04.2023	USD	1.626	EUR	1.500	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
19.04.2023	EUR	4.988	USD	5.380	Absicherung	JP Morgan Chase New York	45
19.04.2023	USD	4.618	EUR	4.235	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
							USD 310.224

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	435.118	USD	468.058	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.177
19.04.2023	USD	7.935	EUR	7.364	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(74)
19.04.2023	USD	4.173	EUR	3.913	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(83)
19.04.2023	USD	679	EUR	623	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	USD	19.018	EUR	17.680	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(210)
19.04.2023	USD	4.209	EUR	3.954	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(92)
19.04.2023	USD	3.338	EUR	3.136	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(73)
19.04.2023	USD	453.528	MXN	8.654.610	Handel	Citigroup Global Markets	(24.106)
19.04.2023	USD	8	NOK	83	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	8	SEK	79	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	42.803	SGD	57.627	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(566)
19.04.2023	USD	262.328	SGD	349.580	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(761)
19.04.2023	USD	52.781	SGD	69.871	Absicherung	JP Morgan Chase New York	197
19.04.2023	USD	1.161.333	SGD	1.568.763	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19.284)
19.04.2023	USD	50	SGD	67	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	EUR	328.478	USD	353.345	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.909
19.04.2023	SGD	4.936.860	USD	3.667.816	Absicherung	JP Morgan Chase New York	47.595
19.04.2023	SGD	466	USD	350	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	EUR	3.792	USD	4.110	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14
19.04.2023	EUR	3.026	USD	3.281	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
19.04.2023	EUR	5.068	USD	5.493	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
19.04.2023	SGD	37.502	USD	28.263	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(40)
19.04.2023	SEK	81	USD	8	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	NOK	80	USD	8	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	29.840	USD	32.539	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(85)
19.04.2023	EUR	97	USD	106	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SEK	6.843	USD	648	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
19.04.2023	NOK	6.970	USD	664	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
19.04.2023	EUR	333.928	USD	359.207	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.973
19.04.2023	EUR	281.337	USD	302.635	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.348

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	USD	961.665	EUR	888.081	Handel	Lloyds	(4.209)
19.04.2023	USD	5.366	EUR	5.042	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(117)
							USD 14.559

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	SGD	199	USD	147	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	NOK	7.406	USD	705	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
19.04.2023	EUR	864.150	USD	929.569	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10.282
19.04.2023	EUR	2.834.630	USD	3.049.221	Absicherung	JP Morgan Chase New York	33.729
19.04.2023	EUR	9.246.813	USD	9.946.827	Absicherung	JP Morgan Chase New York	110.026
19.04.2023	EUR	11.053.763	USD	11.890.568	Absicherung	JP Morgan Chase New York	131.528
19.04.2023	EUR	10.000	USD	10.806	Absicherung	JP Morgan Chase New York	70
19.04.2023	USD	191.271	EUR	176.635	Handel	Lloyds	(837)
19.04.2023	USD	63.818	EUR	59.223	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(593)
19.04.2023	USD	459	EUR	423	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	USD	446	EUR	418	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
19.04.2023	USD	28	EUR	26	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	159.990	USD	118.864	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.542
19.04.2023	USD	3.523	SGD	4.692	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
19.04.2023	USD	135	SGD	179	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	2.008	SGD	2.667	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	6.805	SGD	9.032	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
19.04.2023	USD	3.666	SGD	4.924	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(40)
19.04.2023	SGD	236	USD	177	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	12	USD	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	99	USD	75	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	229.780	USD	170.714	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.215
19.04.2023	EUR	99.990	USD	105.522	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.227
19.04.2023	SEK	7.325	USD	694	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
19.04.2023	EUR	152.609	USD	164.161	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.816
19.04.2023	USD	1.941	SGD	2.596	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
19.04.2023	EUR	207	USD	226	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
							USD 292.959

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	USD	2.023	EUR	1.887	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(30)
19.04.2023	SGD	477.359	USD	354.652	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.602
19.04.2023	SGD	1	USD	1	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	SGD	1.846	USD	1.380	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
19.04.2023	SGD	1	USD	1	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	14.682	USD	10.974	Absicherung	JP Morgan Chase New York	76
19.04.2023	SGD	14.380	USD	10.685	Absicherung	JP Morgan Chase New York	137
19.04.2023	SGD	1	USD	1	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	38.088	USD	28.669	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
19.04.2023	SGD	3.128.661	USD	2.324.424	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30.163
19.04.2023	SGD	1	USD	1	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	6.117	USD	4.593	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
19.04.2023	SGD	1	USD	1	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	5.445	USD	4.058	Absicherung	JP Morgan Chase New York	40
19.04.2023	SGD	14.426	USD	10.717	Absicherung	JP Morgan Chase New York	140
19.04.2023	SGD	1	USD	1	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	13.044	USD	9.656	Absicherung	JP Morgan Chase New York	160
19.04.2023	SGD	62.385	USD	46.991	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(41)
19.04.2023	SGD	1	USD	1	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	60	USD	65	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	146.275	USD	157.349	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.741
19.04.2023	EUR	98.361	USD	105.807	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.170
19.04.2023	EUR	298	USD	322	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
19.04.2023	EUR	57.006.583	USD	61.322.164	Absicherung	JP Morgan Chase New York	678.311
19.04.2023	EUR	533.595	USD	573.990	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.349
19.04.2023	SGD	8.180	USD	6.089	Absicherung	JP Morgan Chase New York	67
19.04.2023	EUR	702	USD	755	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
19.04.2023	SGD	620	USD	466	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	SGD	36.558	USD	27.596	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(83)
19.04.2023	USD	1.366	EUR	1.274	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
19.04.2023	USD	28.275	SGD	38.067	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(374)
19.04.2023	USD	330	SGD	439	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SEK	7.583	USD	718	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14
19.04.2023	SEK	7.726	USD	732	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14
19.04.2023	CHF	825	USD	908	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
19.04.2023	SGD	247	USD	183	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
19.04.2023	GBP	660	USD	803	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
19.04.2023	EUR	411.184	USD	442.312	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.893
19.04.2023	NOK	7.714	USD	734	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
19.04.2023	NOK	7.841	USD	747	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
19.04.2023	SGD	1	USD	1	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	1	USD	1	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	1	USD	1	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	3.345	USD	2.510	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
19.04.2023	SGD	37.730	USD	28.502	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(106)
19.04.2023	EUR	2.566	USD	2.770	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21
19.04.2023	SGD	1	USD	1	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	10.661	EUR	9.893	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(99)
19.04.2023	USD	5.401	EUR	5.077	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(121)
19.04.2023	USD	224	EUR	209	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
19.04.2023	USD	10	EUR	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	1	USD	1	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	SGD	7.113	USD	5.360	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
19.04.2023	EUR	30	USD	32	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	EUR	54.826	USD	58.976	Absicherung	JP Morgan Chase New York	652
							USD 727.720

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	USD	18	SGD	24	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	46.126	USD	34.269	Absicherung	JP Morgan Chase New York	445
19.04.2023	SGD	488.147	USD	362.667	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.706
19.04.2023	EUR	902.054	USD	970.343	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10.733
19.04.2023	THB	22.300.000	USD	648.539	Handel	Citigroup Global Markets	4.985
19.04.2023	EUR	6.229	USD	6.693	Absicherung	JP Morgan Chase New York	81
19.04.2023	SGD	1.000	USD	744	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
19.04.2023	SEK	7.339	USD	695	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
19.04.2023	SGD	5.128	USD	3.808	Absicherung	JP Morgan Chase New York	52
19.04.2023	EUR	384	USD	416	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	SGD	238	USD	178	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	285	USD	213	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	SGD	30	USD	23	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	9.069	USD	9.670	Absicherung	JP Morgan Chase New York	193
19.04.2023	SGD	46	USD	35	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	321	USD	348	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	SGD	889	USD	670	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	SGD	297	USD	222	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	SGD	226	USD	170	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	3.988	USD	4.243	Absicherung	JP Morgan Chase New York	95
19.04.2023	EUR	608.395	USD	654.452	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7.239
19.04.2023	AUD	838	USD	561	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	EUR	14.727.649	USD	15.842.580	Absicherung	JP Morgan Chase New York	175.240
19.04.2023	USD	87.133	EUR	82.565	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.662)
19.04.2023	USD	5.342	EUR	4.952	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
19.04.2023	USD	5	SGD	7	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	10.976	EUR	10.066	Absicherung	JP Morgan Chase New York	29
19.04.2023	USD	54.190	EUR	50.205	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(412)
19.04.2023	USD	27	SGD	35	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	609	SGD	808	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	USD	123	EUR	112	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	USD	10	SGD	13	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	864.840	PHP	47.134.664	Handel	Citigroup Global Markets	(3.047)
19.04.2023	USD	391	SGD	519	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	1.185	USD	881	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
19.04.2023	SGD	486	USD	361	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	SGD	13	USD	10	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	634	USD	772	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
19.04.2023	SGD	1.187	USD	879	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	AUD	9	USD	6	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	AUD	1.020	USD	683	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	USD	1.451	EUR	1.346	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
19.04.2023	USD	27.292	EUR	25.371	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(302)
19.04.2023	USD	6	AUD	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	274	USD	204	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
							USD 197.394

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
02.06.2023	GBP	1.600.000	EUR	1.821.342	Handel	Barclays	(4.745)
02.06.2023	USD	1.900.000	EUR	1.794.571	Handel	Barclays	(52.190)
02.06.2023	USD	1.990.000	EUR	1.866.655	Handel	Barclays	(41.740)
02.06.2023	JPY	89.300.003	EUR	628.585	Handel	Barclays	(7.426)
02.06.2023	JPY	69.500.000	EUR	499.983	Handel	Barclays	(16.550)
02.06.2023	JPY	15.750.000	EUR	111.746	Handel	Citigroup Global Markets	(2.191)
02.06.2023	GBP	32.049	EUR	36.093	Handel	Barclays	295
02.06.2023	USD	199.086	EUR	182.350	Handel	Barclays	220
02.06.2023	USD	15.000	EUR	13.861	Handel	Citigroup Global Markets	(105)
02.06.2023	EUR	2.583.159	GBP	2.300.000	Handel	Citigroup Global Markets	(28.266)
02.06.2023	EUR	690.322	JPY	99.200.000	Handel	Citigroup Global Markets	298
02.06.2023	EUR	2.567.231	USD	2.750.000	Handel	Barclays	45.532
02.06.2023	EUR	534.025	JPY	76.000.000	Handel	Barclays	5.348
02.06.2023	EUR	742.389	USD	805.000	Handel	Citigroup Global Markets	4.186
02.06.2023	EUR	508.349	USD	550.000	Handel	Barclays	3.990
02.06.2023	GBP	640.000	EUR	726.720	Handel	Citigroup Global Markets	(81)
24.04.2023	EUR	63.000	USD	68.651	Handel	Barclays	(103)
							EUR (93.528)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
02.06.2023	EUR	240.000	USD	257.092	Handel	Lloyds	4.619
02.06.2023	GBP	1.620.000	USD	1.948.850	Handel	Lloyds	56.839
02.06.2023	JPY	82.755.000	USD	616.908	Handel	Lloyds	10.798
19.04.2023	USD	10.748	EUR	9.857	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28
19.04.2023	USD	25	EUR	24	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	USD	6.415	EUR	5.937	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
19.04.2023	USD	2.895	EUR	2.669	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
19.04.2023	USD	10.312	EUR	9.570	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(96)
19.04.2023	USD	16	GBP	13	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SEK	7.069	USD	670	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
19.04.2023	GBP	626	USD	762	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
19.04.2023	EUR	80	USD	87	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	6.855.916	USD	7.374.930	Absicherung	JP Morgan Chase New York	81.576
19.04.2023	EUR	107.150	USD	115.262	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.275
19.04.2023	EUR	148	USD	161	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	1.650.806	USD	1.775.777	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19.643
19.04.2023	GBP	13	USD	16	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	716.351	USD	770.581	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8.524
							USD 183.181

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
02.06.2023	EUR	9.300.000	USD	9.957.685	Handel	JP Morgan	183.612
09.05.2023	USD	4.937	JPY	654.242	Handel	Lloyds	(9)
04.05.2023	USD	4.544.957	EUR	4.168.982	Handel	JP Morgan	6.815
04.05.2023	USD	1.393.312	GBP	1.124.130	Handel	Lloyds	2.397
04.05.2023	USD	53.942	CAD	73.029	Handel	NatWest Markets	(47)
19.04.2023	CHF	831	USD	915	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
19.04.2023	SGD	131.402	USD	97.625	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.267
19.04.2023	USD	48.068	EUR	45.161	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.049)
19.04.2023	USD	157.536	EUR	145.320	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(514)
19.04.2023	USD	2.158	SGD	2.865	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	USD	32.165	EUR	29.657	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(90)
19.04.2023	USD	16.955	EUR	15.633	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(47)
19.04.2023	USD	4.350	EUR	4.030	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(33)
19.04.2023	USD	24.956	EUR	23.121	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(190)
19.04.2023	USD	23.050	EUR	21.452	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(280)
19.04.2023	USD	15.570	EUR	14.628	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(340)
19.04.2023	USD	214.677	EUR	201.696	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.683)
19.04.2023	USD	15	EUR	14	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	19.558	EUR	18.202	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(238)
19.04.2023	USD	28.851	EUR	26.415	Absicherung	JP Morgan Chase New York	122
19.04.2023	USD	25.302	EUR	23.415	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(164)
19.04.2023	USD	16.269	EUR	15.056	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(106)
19.04.2023	USD	20.324	EUR	19.060	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(405)
19.04.2023	USD	7.271	EUR	6.819	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(145)
19.04.2023	USD	9.395	EUR	8.749	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(121)
19.04.2023	USD	57.841	EUR	53.865	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(742)
19.04.2023	USD	9.542	EUR	8.870	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(106)
19.04.2023	USD	616.352	EUR	579.083	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13.447)
19.04.2023	USD	318.739	EUR	299.466	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.954)
19.04.2023	SGD	93	USD	69	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	12	EUR	11	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	98.814	USD	104.282	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.189
19.04.2023	SGD	1.206	USD	909	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	EUR	22.779	USD	24.879	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(105)
19.04.2023	EUR	747.963	USD	804.586	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8.900
19.04.2023	EUR	710	USD	764	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	2.285	USD	2.411	Absicherung	JP Morgan Chase New York	74
19.04.2023	USD	5.638	EUR	5.232	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(52)
19.04.2023	USD	18	CHF	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	9.985	USD	10.824	Absicherung	JP Morgan Chase New York	35
19.04.2023	EUR	48.336	USD	52.759	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(189)
19.04.2023	EUR	5.584	USD	5.892	Absicherung	JP Morgan Chase New York	180
19.04.2023	CHF	18	USD	19	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	225.158	USD	245.762	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(880)
19.04.2023	SGD	6.612	USD	4.913	Absicherung	JP Morgan Chase New York	64
19.04.2023	EUR	10.045.773	USD	10.806.270	Absicherung	JP Morgan Chase New York	119.533
19.04.2023	EUR	6.986	USD	7.432	Absicherung	JP Morgan Chase New York	166
19.04.2023	EUR	6.108	USD	6.498	Absicherung	JP Morgan Chase New York	145
19.04.2023	EUR	14.596.781	USD	15.701.804	Absicherung	JP Morgan Chase New York	173.684
19.04.2023	EUR	14.778	USD	15.925	Absicherung	JP Morgan Chase New York	148
19.04.2023	EUR	28.832.207	USD	31.014.898	Absicherung	JP Morgan Chase New York	343.068
19.04.2023	USD	7.800	EUR	7.153	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20
19.04.2023	USD	4.952	EUR	4.541	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
19.04.2023	EUR	16.470	USD	17.977	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(64)
19.04.2023	EUR	2.181.949	USD	2.347.129	Absicherung	JP Morgan Chase New York	25.963
18.04.2023	USD	41.268	EUR	38.436	Handel	JP Morgan	(532)
18.04.2023	EUR	1.635	USD	1.739	Handel	Barclays	39
18.04.2023	AUD	46.489	USD	32.162	Handel	JP Morgan	(1.006)
18.04.2023	CNY	16.829	USD	2.451	Handel	Barclays	3
18.04.2023	CNY	23.895	USD	3.497	Handel	UBS	(13)
18.04.2023	EUR	601.223	USD	646.778	Handel	Barclays	7.077
18.04.2023	USD	12.931	CNY	89.491	Handel	HSBC	(118)
18.04.2023	USD	134.005	EUR	125.233	Handel	UBS	(2.189)
18.04.2023	USD	5.447	EUR	4.992	Handel	NatWest Markets	18
18.04.2023	JPY	730.032	USD	5.514	Handel	HSBC	(13)
18.04.2023	USD	6.603	GBP	5.414	Handel	HSBC	(94)
18.04.2023	SGD	16.213	USD	12.235	Handel	Lloyds	(34)
18.04.2023	JPY	405.512	USD	3.005	Handel	Goldman Sachs	51
18.04.2023	EUR	5.752	USD	6.140	Handel	JP Morgan	116
18.04.2023	USD	4.199	JPY	568.484	Handel	JP Morgan	(84)
18.04.2023	THB	602.030	USD	17.889	Handel	HSBC	(248)
18.04.2023	EUR	4.004	USD	4.303	Handel	NatWest Markets	51
18.04.2023	NOK	48.675	USD	4.803	Handel	HSBC	(151)
18.04.2023	MXN	1.170.185	USD	62.219	Handel	HSBC	2.361
18.04.2023	JPY	74.378.134	USD	562.598	Handel	Barclays	(2.139)
18.04.2023	CHF	27.089	USD	29.567	Handel	NatWest Markets	143
18.04.2023	CAD	18.984	USD	14.176	Handel	HSBC	(145)
18.04.2023	NZD	14.125	USD	8.881	Handel	Citigroup Global Markets	(43)
18.04.2023	JPY	639.405	USD	4.857	Handel	HSBC	(39)
18.04.2023	GBP	131.327	USD	160.099	Handel	Barclays	2.341
18.04.2023	JPY	5.450.263	USD	40.781	Handel	HSBC	288
18.04.2023	EUR	59.365	USD	62.632	Handel	UBS	1.930
18.04.2023	EUR	3.622	USD	3.899	Handel	UBS	40
18.04.2023	KRW	79.474.929	USD	62.816	Handel	Citigroup Global Markets	(1.797)
18.04.2023	AUD	3.229	USD	2.136	Handel	HSBC	28

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
18.04.2023	CNY	592.791	USD	87.374	Handel	HSBC	(931)
18.04.2023	USD	3.510	EUR	3.316	Handel	UBS	(96)
18.04.2023	USD	126.232	GBP	105.340	Handel	HSBC	(4.063)
18.04.2023	USD	4.382	GBP	3.630	Handel	HSBC	(108)
18.04.2023	GBP	4.654	USD	5.761	Handel	JP Morgan	(4)
18.04.2023	IDR	355.453.455	USD	23.448	Handel	HSBC	325
18.04.2023	USD	6.419	GBP	5.239	Handel	UBS	(61)
18.04.2023	USD	146.620	GBP	121.789	Handel	HSBC	(4.021)
18.04.2023	GBP	3.599	USD	4.329	Handel	HSBC	122
18.04.2023	JPY	294.719	USD	2.233	Handel	HSBC	(12)
18.04.2023	USD	10.732	GBP	8.820	Handel	UBS	(177)
18.04.2023	USD	72.270	GBP	59.756	Handel	HSBC	(1.642)
18.04.2023	USD	149.277	GBP	124.933	Handel	NatWest Markets	(5.252)
18.04.2023	SEK	231.471	USD	22.394	Handel	UBS	(49)
05.04.2023	GBP	16.386	USD	20.090	Handel	Lloyds	173
05.04.2023	EUR	300.000	USD	319.540	Handel	HSBC	6.478
05.04.2023	GBP	8.762	USD	10.583	Handel	NatWest Markets	252
05.04.2023	GBP	25.919	USD	31.755	Handel	Lloyds	295
05.04.2023	EUR	68.190	USD	73.499	Handel	JP Morgan	605
05.04.2023	GBP	13.715	USD	16.687	Handel	Citigroup Global Markets	273
05.04.2023	EUR	75.811	USD	80.568	Handel	JP Morgan	1.817
05.04.2023	EUR	140.526	USD	151.017	Handel	JP Morgan	1.696
05.04.2023	EUR	98.983	USD	106.149	Handel	Citigroup Global Markets	1.418
05.04.2023	USD	20.618.318	EUR	19.421.671	Handel	Lloyds	(487.594)
05.04.2023	USD	144.754	GBP	118.540	Handel	Citigroup Global Markets	(1.829)
05.04.2023	USD	102.602	GBP	86.630	Handel	Lloyds	(4.522)
05.04.2023	USD	9.802	GBP	8.160	Handel	JP Morgan	(289)
05.04.2023	USD	119.560	GBP	100.000	Handel	Lloyds	(4.097)
05.04.2023	USD	3.585.463	GBP	3.003.384	Handel	Lloyds	(128.415)
05.04.2023	USD	208.081	EUR	194.090	Handel	HSBC	(2.841)
05.04.2023	USD	53.755	EUR	49.890	Handel	Goldman Sachs	(461)
05.04.2023	USD	26.978	GBP	21.957	Handel	NatWest Markets	(173)
05.04.2023	USD	124.923	EUR	116.990	Handel	Goldman Sachs	(2.213)
05.04.2023	USD	204.999	EUR	189.886	Handel	UBS	(1.354)
05.04.2023	USD	79.630	EUR	75.000	Handel	JP Morgan	(1.874)
05.04.2023	GBP	11.554	USD	13.981	Handel	NatWest Markets	307
05.04.2023	EUR	104.454	USD	111.787	Handel	NatWest Markets	1.725
04.04.2023	CAD	946	USD	694	Handel	JP Morgan	5
04.04.2023	USD	155	JPY	20.767	Handel	JP Morgan	(1)
04.04.2023	CAD	4.743	USD	3.471	Handel	JP Morgan	34
04.04.2023	USD	62	JPY	8.236	Handel	JP Morgan	1
04.04.2023	USD	37	JPY	4.938	Handel	JP Morgan	0
04.04.2023	CAD	1.750	USD	1.291	Handel	JP Morgan	3
04.04.2023	USD	4.657	JPY	627.673	Handel	JP Morgan	(62)
04.04.2023	CAD	1.969	USD	1.437	Handel	Citigroup Global Markets	18
04.04.2023	EUR	125.000	USD	135.484	Handel	Lloyds	348
04.04.2023	JPY	4.152	USD	32	Handel	Barclays	(1)
04.04.2023	CAD	1.853	USD	1.361	Handel	JP Morgan	8
04.04.2023	GBP	8.220	USD	10.071	Handel	Lloyds	94

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
04.04.2023	CAD	3.130	USD	2.286	Handel	JP Morgan	27
04.04.2023	JPY	4.609	USD	34	Handel	JP Morgan	1
04.04.2023	CAD	1.621	USD	1.186	Handel	JP Morgan	12
04.04.2023	JPY	3.702	USD	27	Handel	JP Morgan	1
04.04.2023	USD	97	JPY	12.949	Handel	JP Morgan	(1)
04.04.2023	USD	3.027	CAD	4.115	Handel	Goldman Sachs	(14)
04.04.2023	USD	1.335.881	GBP	1.106.140	Handel	Lloyds	(31.902)
04.04.2023	USD	3.064	CAD	4.197	Handel	JP Morgan	(38)
04.04.2023	USD	1.247	CAD	1.719	Handel	JP Morgan	(24)
04.04.2023	USD	4.895	CAD	6.722	Handel	JP Morgan	(73)
04.04.2023	USD	872	CAD	1.199	Handel	JP Morgan	(14)
04.04.2023	USD	1.731	CAD	2.395	Handel	JP Morgan	(38)
04.04.2023	USD	3.656	CAD	5.000	Handel	JP Morgan	(39)
04.04.2023	USD	431	CAD	591	Handel	NatWest Markets	(6)
04.04.2023	USD	45.929	CAD	62.372	Handel	JP Morgan	(161)
04.04.2023	JPY	16.768	USD	126	Handel	JP Morgan	0
04.04.2023	USD	1.068	CAD	1.468	Handel	JP Morgan	(17)
04.04.2023	CAD	1.458	USD	1.072	Handel	JP Morgan	6
04.04.2023	USD	4.596.553	EUR	4.293.982	Handel	Lloyds	(69.519)
04.04.2023	CAD	3.553	USD	2.594	Handel	JP Morgan	32
04.04.2023	JPY	8.403	USD	64	Handel	Goldman Sachs	(1)
04.04.2023	CAD	1.067	USD	776	Handel	JP Morgan	13
04.04.2023	USD	3.885	CAD	5.339	Handel	JP Morgan	(60)
04.04.2023	USD	121.958	GBP	99.310	Handel	HSBC	(843)
04.04.2023	USD	48	JPY	6.373	Handel	JP Morgan	0
04.04.2023	GBP	98.100	USD	120.916	Handel	Lloyds	389
							USD 105.827

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	67.753	USD	72.882	Absicherung	JP Morgan Chase New York	805
19.04.2023	EUR	715	USD	769	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
19.04.2023	EUR	22	USD	24	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	23	USD	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	23	USD	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	2.051	USD	2.223	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
19.04.2023	EUR	22	USD	23	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	728	USD	783	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
19.04.2023	EUR	747	USD	804	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
19.04.2023	EUR	751	USD	808	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
19.04.2023	USD	16	EUR	15	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	16	EUR	15	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	16	EUR	15	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	1.458	EUR	1.370	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(32)
19.04.2023	USD	15	EUR	14	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
							USD 816

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Focus die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	5.000	USD	5.388	Absicherung	JP Morgan Chase New York	50
19.04.2023	EUR	1.845.532	USD	2.003.497	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.707
19.04.2023	EUR	2.398	USD	2.558	Absicherung	JP Morgan Chase New York	51
19.04.2023	SGD	52.942	USD	39.850	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
19.04.2023	SGD	21.428	USD	16.146	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
19.04.2023	SGD	762.653	USD	566.609	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7.353
19.04.2023	EUR	54.542.699	USD	58.671.756	Absicherung	JP Morgan Chase New York	648.992
19.04.2023	EUR	657.865	USD	714.174	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.321
19.04.2023	EUR	26.548.752	USD	28.558.577	Absicherung	JP Morgan Chase New York	315.898
19.04.2023	USD	3.540	EUR	3.295	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43)
19.04.2023	USD	80.918	EUR	75.306	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(984)
19.04.2023	USD	32.023	EUR	30.031	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(638)
19.04.2023	USD	18.239	EUR	17.104	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(363)
19.04.2023	USD	16.388	EUR	15.166	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(107)
19.04.2023	USD	30.224	EUR	27.971	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(196)
19.04.2023	USD	3.741	SGD	5.004	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(25)
19.04.2023	USD	48.949	EUR	45.132	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(137)
19.04.2023	EUR	62.990	USD	68.382	Absicherung	JP Morgan Chase New York	127
19.04.2023	SGD	11.077	USD	8.318	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
19.04.2023	EUR	33.927	USD	36.092	Absicherung	JP Morgan Chase New York	807
19.04.2023	EUR	1.252.045	USD	1.366.618	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.891)
19.04.2023	SGD	1.000	USD	755	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
19.04.2023	EUR	1.521.898	USD	1.641.361	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13.858
19.04.2023	EUR	4.118	USD	4.422	Absicherung	JP Morgan Chase New York	57
19.04.2023	EUR	120.342	USD	129.224	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.660
19.04.2023	CHF	18	USD	20	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	53.921	USD	58.798	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(154)
19.04.2023	EUR	2.298.816	USD	2.472.844	Absicherung	JP Morgan Chase New York	27.353
19.04.2023	EUR	22.810	USD	24.072	Absicherung	JP Morgan Chase New York	736
19.04.2023	EUR	2.660	USD	2.808	Absicherung	JP Morgan Chase New York	86
19.04.2023	EUR	113.634	USD	122.021	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.567
19.04.2023	EUR	606	USD	661	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
19.04.2023	EUR	246	USD	265	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	CHF	742	USD	818	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
19.04.2023	USD	131.910	EUR	121.625	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(369)
19.04.2023	USD	309.935	EUR	288.128	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.429)
19.04.2023	USD	55.412	EUR	51.513	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(613)
19.04.2023	USD	57.597	EUR	53.130	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(188)
19.04.2023	EUR	72.915.994	USD	78.435.968	Absicherung	JP Morgan Chase New York	867.612
19.04.2023	EUR	11.533	USD	12.392	Absicherung	JP Morgan Chase New York	151
19.04.2023	EUR	17.258	USD	18.403	Absicherung	JP Morgan Chase New York	367
19.04.2023	EUR	566	USD	611	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	SGD	20.000	USD	15.070	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
19.04.2023	USD	241	EUR	222	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	EUR	24.141	USD	26.086	Absicherung	JP Morgan Chase New York	170
19.04.2023	EUR	990	USD	1.065	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
19.04.2023	SGD	1.583	USD	1.189	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	EUR	5.702	USD	6.184	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	SGD	1.000	USD	743	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
19.04.2023	EUR	3.392	USD	3.648	Absicherung	JP Morgan Chase New York	40
19.04.2023	SGD	1.303	USD	964	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16
19.04.2023	SGD	480	USD	357	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	USD	40.721	EUR	37.563	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(133)
19.04.2023	USD	41.105	EUR	38.108	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(341)
19.04.2023	USD	69.527	EUR	63.759	Absicherung	JP Morgan Chase New York	182
19.04.2023	USD	6.478	EUR	6.138	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(198)
19.04.2023	USD	149.838	EUR	140.848	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.345)
19.04.2023	USD	201.087	EUR	186.610	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.868)
19.04.2023	USD	17.579	EUR	16.095	Absicherung	JP Morgan Chase New York	74
19.04.2023	USD	1.280	EUR	1.172	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	USD	17.129	EUR	16.101	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(382)
19.04.2023	USD	26.256	EUR	24.039	Absicherung	JP Morgan Chase New York	111
19.04.2023	USD	50.273	EUR	46.575	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(382)
19.04.2023	USD	1.527	EUR	1.414	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
19.04.2023	USD	53.854	EUR	49.893	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(410)
19.04.2023	USD	3.642	EUR	3.376	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(30)
19.04.2023	USD	49.156	EUR	45.572	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(408)
19.04.2023	USD	170.109	EUR	161.191	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.197)
19.04.2023	USD	7.719	EUR	7.189	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(99)
19.04.2023	USD	1.171	EUR	1.074	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
19.04.2023	EUR	35.500	USD	38.254	Absicherung	JP Morgan Chase New York	356
19.04.2023	EUR	66.431	USD	70.671	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.579
							USD 1.869.364

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	491	USD	518	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16
19.04.2023	EUR	99	USD	106	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	EUR	386.493	USD	415.751	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.599
19.04.2023	EUR	794.022	USD	854.132	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9.448
19.04.2023	EUR	592.902	USD	637.787	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7.055
19.04.2023	EUR	22.194	USD	24.058	Absicherung	JP Morgan Chase New York	80
19.04.2023	EUR	11.002	USD	12.009	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43)
19.04.2023	EUR	17.134	USD	18.702	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(67)
19.04.2023	USD	16.623	EUR	15.618	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(363)
							USD 20.726

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Equity Income die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	65	USD	70	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	8.629	SGD	11.621	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(117)

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	USD	16.730	SGD	22.531	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(227)
19.04.2023	USD	89.808	SGD	120.950	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.217)
19.04.2023	USD	910	AUD	1.365	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
19.04.2023	USD	21	EUR	20	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	90	EUR	84	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	USD	2.604	SGD	3.484	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
19.04.2023	SGD	496	USD	367	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
19.04.2023	AUD	56.209	USD	37.616	Absicherung	JP Morgan Chase New York	55
19.04.2023	AUD	1.191	USD	799	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	AUD	1.555	USD	1.042	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	198	USD	147	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	SGD	1.884	USD	1.395	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23
19.04.2023	EUR	3.147	USD	3.385	Absicherung	JP Morgan Chase New York	37
19.04.2023	SGD	53	USD	40	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	12.423	USD	9.361	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
19.04.2023	SGD	21.235	USD	16.001	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
19.04.2023	SGD	97.422	USD	73.408	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(90)
19.04.2023	SGD	99	USD	74	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	SGD	149	USD	111	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	SGD	119	USD	89	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	SGD	433.942	USD	322.395	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.184
19.04.2023	SGD	839.488	USD	623.694	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8.093
19.04.2023	SGD	4.506.512	USD	3.348.091	Absicherung	JP Morgan Chase New York	43.447
19.04.2023	SGD	785	USD	591	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	SGD	134	USD	101	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	99	USD	74	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	EUR	15	USD	16	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	8.465	USD	6.356	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
19.04.2023	EUR	727	USD	782	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
							USD 54.167

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	GBP	1.340	EUR	1.516	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
19.04.2023	GBP	635	EUR	718	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	EUR	7.439	GBP	6.580	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(45)
19.04.2023	EUR	7.363	GBP	6.502	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(32)
19.04.2023	EUR	18.964	GBP	16.677	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
19.04.2023	GBP	215	EUR	245	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	GBP	2.883.833	EUR	3.262.278	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17.520
19.04.2023	CHF	4.778.686	EUR	4.891.475	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(72.068)
19.04.2023	GBP	1.179	EUR	1.337	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	GBP	60.729	EUR	68.982	Absicherung	JP Morgan Chase New York	86
19.04.2023	GBP	635	EUR	722	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	14.675	EUR	16.760	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(70)
19.04.2023	GBP	799	EUR	907	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	GBP	5.000	EUR	5.676	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
19.04.2023	CHF	787	EUR	805	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
19.04.2023	GBP	14	EUR	16	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	44.412	CHF	43.430	Absicherung	JP Morgan Chase New York	612
							EUR (53.987)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - American die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	98	USD	106	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	23.305	USD	24.594	Absicherung	JP Morgan Chase New York	752
19.04.2023	EUR	623	USD	680	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
19.04.2023	EUR	3.006.809	USD	3.281.959	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11.747)
19.04.2023	EUR	1.810.668	USD	1.947.741	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21.545
19.04.2023	EUR	47.802.509	USD	51.511.090	Absicherung	JP Morgan Chase New York	479.014
19.04.2023	EUR	772	USD	821	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
19.04.2023	EUR	15	USD	16	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	9.489	USD	10.137	Absicherung	JP Morgan Chase New York	183
19.04.2023	EUR	19.759	USD	21.109	Absicherung	JP Morgan Chase New York	381
19.04.2023	EUR	1.514	USD	1.633	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14
19.04.2023	EUR	3.333	USD	3.595	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30
19.04.2023	EUR	24.190.994	USD	26.022.329	Absicherung	JP Morgan Chase New York	287.843
19.04.2023	EUR	47.335	USD	51.093	Absicherung	JP Morgan Chase New York	389
19.04.2023	EUR	56	USD	61	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	56.284	USD	61.375	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(161)
19.04.2023	EUR	67.439	USD	72.743	Absicherung	JP Morgan Chase New York	604
19.04.2023	EUR	20.655.667	USD	22.219.367	Absicherung	JP Morgan Chase New York	245.778
19.04.2023	EUR	73.725	USD	79.219	Absicherung	JP Morgan Chase New York	964
19.04.2023	EUR	15.637	USD	16.803	Absicherung	JP Morgan Chase New York	205
19.04.2023	EUR	715	USD	769	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
19.04.2023	EUR	451.834	USD	486.040	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.376
19.04.2023	EUR	949.092	USD	1.020.941	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11.293
19.04.2023	EUR	3.285.087	USD	3.533.725	Absicherung	JP Morgan Chase New York	39.142
19.04.2023	EUR	2.693.718	USD	2.910.752	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18.942
19.04.2023	EUR	2	USD	2	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	3.098	EUR	2.875	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(29)
19.04.2023	USD	34.829	EUR	32.322	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(324)
19.04.2023	USD	9.263	EUR	8.573	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(60)
19.04.2023	EUR	8.040.978	USD	8.574.373	Absicherung	JP Morgan Chase New York	171.011
19.04.2023	EUR	601.030	USD	642.079	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11.602
19.04.2023	EUR	704.176	USD	752.270	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13.593
19.04.2023	EUR	37.433	USD	39.989	Absicherung	JP Morgan Chase New York	723
19.04.2023	EUR	672.360	USD	718.281	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12.979
19.04.2023	EUR	208	USD	225	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	EUR	207.329	USD	224.758	Absicherung	JP Morgan Chase New York	734
19.04.2023	EUR	33.536.915	USD	36.075.767	Absicherung	JP Morgan Chase New York	399.048
19.04.2023	EUR	8.380.843	USD	9.015.164	Absicherung	JP Morgan Chase New York	99.859

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	100	USD	106	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
19.04.2023	EUR	36.661.707	USD	39.761.872	Absicherung	JP Morgan Chase New York	111.474
19.04.2023	USD	111.181	EUR	105.352	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.396)
19.04.2023	USD	10.805	EUR	10.238	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(330)
19.04.2023	USD	14.669	EUR	13.900	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(448)
19.04.2023	USD	41.575	EUR	38.065	Absicherung	JP Morgan Chase New York	175
19.04.2023	USD	6.679	EUR	6.188	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(51)
19.04.2023	USD	2.195	EUR	2.043	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(27)
19.04.2023	USD	23.406	EUR	22.002	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(523)
19.04.2023	USD	3.119	EUR	2.902	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(38)
19.04.2023	USD	1.206	EUR	1.121	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
19.04.2023	USD	18.014	EUR	16.747	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(199)
19.04.2023	USD	131	EUR	121	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	7.436	EUR	6.973	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(148)
19.04.2023	USD	60.794	EUR	57.012	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.211)
19.04.2023	USD	2.541	EUR	2.352	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
19.04.2023	EUR	6.667	USD	7.184	Absicherung	JP Morgan Chase New York	67
19.04.2023	EUR	62.799	USD	67.434	Absicherung	JP Morgan Chase New York	866
							USD 1.915.892

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - American Select die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	206	USD	220	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	USD	7.151	EUR	6.659	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(92)
19.04.2023	USD	8.519	EUR	7.858	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(28)
19.04.2023	EUR	175.878	USD	189.193	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.093
19.04.2023	EUR	398.745	USD	428.931	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.745
19.04.2023	EUR	519.514	USD	558.843	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.183
19.04.2023	EUR	1.686	USD	1.812	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
19.04.2023	EUR	14.943	USD	16.056	Absicherung	JP Morgan Chase New York	195
19.04.2023	EUR	14.853	USD	15.977	Absicherung	JP Morgan Chase New York	177
19.04.2023	USD	346	EUR	320	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
19.04.2023	EUR	9.234	USD	9.933	Absicherung	JP Morgan Chase New York	110
19.04.2023	EUR	664	USD	714	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
19.04.2023	EUR	69	USD	73	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	EUR	331	USD	354	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
19.04.2023	EUR	11.681	USD	12.479	Absicherung	JP Morgan Chase New York	225
19.04.2023	EUR	8.649	USD	9.240	Absicherung	JP Morgan Chase New York	167
19.04.2023	EUR	3.941	USD	4.210	Absicherung	JP Morgan Chase New York	76
19.04.2023	EUR	15	USD	16	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	5.198	USD	5.554	Absicherung	JP Morgan Chase New York	100
19.04.2023	EUR	234.443	USD	252.191	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.790
19.04.2023	USD	6.328	EUR	5.996	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(193)
							USD 16.587

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	USD	9.287	EUR	8.699	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(174)
19.04.2023	EUR	1.485.596	USD	1.602.209	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13.528
19.04.2023	EUR	1.568	USD	1.691	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14
19.04.2023	EUR	7.045	USD	7.598	Absicherung	JP Morgan Chase New York	64
19.04.2023	EUR	54.371	USD	58.639	Absicherung	JP Morgan Chase New York	495
19.04.2023	EUR	63.438	USD	68.475	Absicherung	JP Morgan Chase New York	521
19.04.2023	EUR	721	USD	768	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
19.04.2023	EUR	10.000	USD	10.663	Absicherung	JP Morgan Chase New York	213
19.04.2023	EUR	5.000	USD	5.277	Absicherung	JP Morgan Chase New York	161
19.04.2023	EUR	63.273	USD	68.371	Absicherung	JP Morgan Chase New York	445
19.04.2023	USD	1.928.258	EUR	1.806.230	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(36.163)
19.04.2023	USD	13	SGD	18	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	5.794	EUR	5.368	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
19.04.2023	USD	16	SGD	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	16	SGD	22	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	9.719	EUR	9.035	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(108)
19.04.2023	USD	449	EUR	411	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	USD	2.038	EUR	1.909	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(38)
19.04.2023	EUR	90.892	USD	97.943	Absicherung	JP Morgan Chase New York	911
19.04.2023	EUR	111.180	USD	117.331	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.588
19.04.2023	EUR	24.858	USD	27.106	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(71)
19.04.2023	USD	71.017	EUR	66.522	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.332)
19.04.2023	USD	22	SGD	29	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	1.402.583	EUR	1.284.466	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.589
19.04.2023	USD	1.480	EUR	1.356	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
19.04.2023	USD	6.700	EUR	6.136	Absicherung	JP Morgan Chase New York	27
19.04.2023	USD	51.573	EUR	47.230	Absicherung	JP Morgan Chase New York	206
19.04.2023	SGD	1.299	USD	965	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
19.04.2023	EUR	2.083.480	USD	2.241.206	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24.791
19.04.2023	SGD	20	USD	15	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	SGD	34	USD	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	14.997	USD	16.258	Absicherung	JP Morgan Chase New York	53
19.04.2023	EUR	5.988	USD	6.434	Absicherung	JP Morgan Chase New York	78
19.04.2023	EUR	56.927.593	USD	61.237.193	Absicherung	JP Morgan Chase New York	677.371
19.04.2023	EUR	60.197	USD	64.754	Absicherung	JP Morgan Chase New York	716
19.04.2023	EUR	272.142	USD	292.744	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.238
19.04.2023	EUR	15.325	USD	16.711	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
19.04.2023	SGD	16	USD	12	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	23.037	USD	24.985	Absicherung	JP Morgan Chase New York	70
							USD 694.141

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	43.437	USD	46.726	Absicherung	JP Morgan Chase New York	517
19.04.2023	EUR	1.073	USD	1.163	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	SGD	371.850	USD	276.264	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.584
19.04.2023	SGD	886	USD	658	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
19.04.2023	SGD	14.652	USD	11.042	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
19.04.2023	SGD	35	USD	27	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
							USD 4.099

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Asia Equities die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	12	USD	13	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	11	USD	12	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	530	USD	570	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
19.04.2023	EUR	525	USD	565	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
							USD 13

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	CHF	788	USD	867	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
19.04.2023	USD	1.485	EUR	1.382	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
19.04.2023	USD	5.702	EUR	5.301	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(63)
19.04.2023	USD	2.415	EUR	2.289	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(74)
19.04.2023	USD	1.964	EUR	1.801	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	USD	16.340	EUR	15.149	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(136)
19.04.2023	USD	7.780	EUR	7.296	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(155)
19.04.2023	USD	7.459	EUR	6.903	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(48)
19.04.2023	USD	4.840	EUR	4.463	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
19.04.2023	USD	5.111	EUR	4.743	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(47)
19.04.2023	USD	8.760	EUR	8.234	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(196)
19.04.2023	SGD	90.831.288	USD	67.482.664	Absicherung	JP Morgan Chase New York	875.691
19.04.2023	SGD	2.211.696	USD	1.667.302	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.810)
19.04.2023	USD	370	EUR	341	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	SGD	3.135.633	USD	2.339.410	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20.423
19.04.2023	GBP	613	USD	746	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
19.04.2023	GBP	21	USD	26	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	799	USD	859	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
19.04.2023	EUR	130.892	USD	142.870	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(511)
19.04.2023	EUR	577.962	USD	621.716	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.877
19.04.2023	EUR	13.282	USD	14.498	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(52)
19.04.2023	EUR	19.639	USD	20.981	Absicherung	JP Morgan Chase New York	379
19.04.2023	EUR	5.676.068	USD	6.105.765	Absicherung	JP Morgan Chase New York	67.538
19.04.2023	EUR	98	USD	106	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	27	USD	29	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	EUR	193.345	USD	206.550	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.732
19.04.2023	CHF	23	USD	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	GBP	15	USD	18	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	2.490	EUR	2.280	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
							USD 970.551

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	776	USD	835	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
19.04.2023	EUR	19	USD	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	19	USD	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	4.990	USD	5.321	Absicherung	JP Morgan Chase New York	106
19.04.2023	EUR	506.802	USD	546.120	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.080
19.04.2023	EUR	1.490	USD	1.615	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	CHF	21	USD	22	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	763	USD	820	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
19.04.2023	CHF	20	USD	22	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	CHF	837	USD	922	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
19.04.2023	EUR	16	USD	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	11.212	USD	12.238	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
19.04.2023	EUR	19	USD	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	749	USD	806	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
19.04.2023	EUR	773	USD	831	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
19.04.2023	CHF	846	USD	932	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
19.04.2023	EUR	20.236	USD	21.768	Absicherung	JP Morgan Chase New York	241
							USD 5.416

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	46	USD	49	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	USD	2.241	EUR	2.065	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
19.04.2023	USD	9.918	EUR	9.220	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(101)
19.04.2023	USD	99	EUR	94	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
19.04.2023	USD	137.801	EUR	128.103	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.402)
19.04.2023	USD	9.918	EUR	9.189	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(69)
19.04.2023	USD	10.340	EUR	9.482	Absicherung	JP Morgan Chase New York	25
19.04.2023	USD	1.064	EUR	989	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
19.04.2023	SGD	17.553	EUR	12.190	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
19.04.2023	SGD	5.207	EUR	3.618	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
19.04.2023	SGD	439.402	EUR	303.763	Absicherung	JP Morgan Chase New York	289
19.04.2023	SGD	2.694	EUR	1.871	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
19.04.2023	SGD	2.663	EUR	1.861	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
19.04.2023	SGD	5.367	EUR	3.742	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(28)
19.04.2023	SGD	6.984	EUR	4.878	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(45)
19.04.2023	SGD	21.594.109	EUR	14.915.595	Absicherung	JP Morgan Chase New York	26.842

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	SGD	2.824	EUR	1.957	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
19.04.2023	SGD	41.715	EUR	28.769	Absicherung	JP Morgan Chase New York	97
19.04.2023	SGD	3.202	EUR	2.227	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
19.04.2023	SGD	33.404	EUR	23.433	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(319)
19.04.2023	EUR	4.060	SGD	5.858	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
19.04.2023	EUR	13.217	SGD	18.989	Absicherung	JP Morgan Chase New York	78
19.04.2023	EUR	581.049	SGD	838.691	Absicherung	JP Morgan Chase New York	702
19.04.2023	EUR	21.260	SGD	30.785	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43)
19.04.2023	EUR	891	SGD	1.287	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	EUR	5.757	USD	6.170	Absicherung	JP Morgan Chase New York	84
19.04.2023	USD	90.420	EUR	84.205	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.068)
19.04.2023	USD	3.122	EUR	2.859	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
							EUR 24.948

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	CHF	60.425	EUR	61.851	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(912)
19.04.2023	SGD	314.062	EUR	216.975	Absicherung	JP Morgan Chase New York	347
19.04.2023	EUR	4.516	USD	4.840	Absicherung	JP Morgan Chase New York	66
19.04.2023	EUR	547	SGD	787	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	EUR	6.984	SGD	10.053	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28
19.04.2023	EUR	13.817	SGD	19.784	Absicherung	JP Morgan Chase New York	128
19.04.2023	EUR	292.486	SGD	422.177	Absicherung	JP Morgan Chase New York	353
19.04.2023	EUR	26.023	SGD	37.409	Absicherung	JP Morgan Chase New York	138
19.04.2023	EUR	23.890	SGD	34.470	Absicherung	JP Morgan Chase New York	38
19.04.2023	EUR	3.499	SGD	5.026	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21
19.04.2023	SGD	504	EUR	349	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	209	SGD	300	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	SGD	1.407	EUR	975	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	SGD	1.575	EUR	1.087	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	USD	3.180	EUR	2.956	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(32)
19.04.2023	USD	136.057	EUR	126.482	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.385)
19.04.2023	SGD	18.607	EUR	13.053	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(178)
19.04.2023	USD	88	EUR	81	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	3.835	EUR	3.514	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
19.04.2023	EUR	108	USD	116	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	CHF	1.548	EUR	1.556	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
19.04.2023	SGD	11.645.914	EUR	8.044.126	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14.476
19.04.2023	EUR	2.332	CHF	2.272	Absicherung	JP Morgan Chase New York	41
							EUR 13.155

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	CHF	57.377	EUR	58.736	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(869)
19.04.2023	EUR	267.753	CHF	260.870	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.655
19.04.2023	EUR	80.593	CHF	78.521	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.401
19.04.2023	EUR	44.833	CHF	44.643	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(190)
19.04.2023	EUR	34.156	CHF	33.978	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(112)
19.04.2023	USD	8.807.227	EUR	8.187.414	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(89.574)
19.04.2023	EUR	20.678	CHF	20.540	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(37)
19.04.2023	CHF	4.881	EUR	4.920	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
19.04.2023	CHF	135.008	EUR	136.078	Absicherung	JP Morgan Chase New York	80
19.04.2023	CHF	185.764	EUR	190.148	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.802)
19.04.2023	CHF	6.803.169	EUR	6.963.740	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(102.601)
19.04.2023	CHF	2.031.801	EUR	2.079.756	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(30.642)
19.04.2023	EUR	7.289	CHF	7.101	Absicherung	JP Morgan Chase New York	127
19.04.2023	USD	1.153.754	EUR	1.072.558	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11.734)
19.04.2023	USD	191.190	EUR	176.375	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(585)
19.04.2023	USD	370.602	EUR	341.885	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.134)
19.04.2023	EUR	5.558	USD	5.989	Absicherung	JP Morgan Chase New York	51
19.04.2023	EUR	92.246	USD	100.000	Absicherung	JP Morgan Chase New York	300
19.04.2023	EUR	83.030	USD	89.314	Absicherung	JP Morgan Chase New York	911
19.04.2023	EUR	292.571	USD	313.558	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.273
19.04.2023	EUR	582.334	USD	624.106	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8.506
19.04.2023	EUR	35.530	USD	38.806	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(151)
19.04.2023	EUR	6.693	USD	7.310	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(28)
19.04.2023	EUR	38.276	USD	41.022	Absicherung	JP Morgan Chase New York	559
19.04.2023	CHF	39.881	EUR	40.197	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24
19.04.2023	USD	25.060	EUR	23.118	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(77)
19.04.2023	USD	17.345.031	EUR	16.124.365	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(176.406)
							EUR (396.052)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - European Select die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	2.664	GBP	2.338	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	GBP	1.306.065	EUR	1.477.460	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7.934
19.04.2023	USD	960	EUR	892	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
19.04.2023	USD	9.906.542	EUR	9.209.364	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(100.755)
19.04.2023	SGD	29.700	EUR	20.483	Absicherung	JP Morgan Chase New York	69
19.04.2023	GBP	250	EUR	283	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	USD	358.114	EUR	329.879	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(609)
19.04.2023	USD	225.308	EUR	207.543	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(383)
19.04.2023	SGD	644.041	EUR	444.945	Absicherung	JP Morgan Chase New York	711
19.04.2023	GBP	14.384	EUR	16.339	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20
19.04.2023	GBP	116.357	EUR	132.344	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
19.04.2023	GBP	5.200.219	EUR	5.882.643	Absicherung	JP Morgan Chase New York	31.592
19.04.2023	USD	27	EUR	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	1.103	EUR	1.247	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	75	GBP	66	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	31.783	SGD	45.689	Absicherung	JP Morgan Chase New York	168
19.04.2023	EUR	158.002	SGD	227.517	Absicherung	JP Morgan Chase New York	567
19.04.2023	EUR	307.848	SGD	443.371	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.050
19.04.2023	EUR	383.701	USD	408.394	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8.209
19.04.2023	EUR	242.517	USD	258.125	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.189
19.04.2023	EUR	212	USD	228	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	EUR	23	USD	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	271	SGD	391	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	139	EUR	158	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	204	SGD	296	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	2.500	EUR	2.852	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
19.04.2023	USD	204.246	EUR	191.188	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.393)
19.04.2023	EUR	2.513	GBP	2.219	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
19.04.2023	EUR	770.283	GBP	680.203	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.317)
19.04.2023	EUR	1.466	GBP	1.289	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	9.353	GBP	8.239	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
19.04.2023	EUR	155.441	GBP	136.757	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(93)
19.04.2023	EUR	39.187	GBP	34.477	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24)
19.04.2023	EUR	8.423	GBP	7.446	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(45)
19.04.2023	USD	19	EUR	18	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	12.659	EUR	14.458	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(60)
19.04.2023	GBP	1.152	EUR	1.308	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	SGD	2.877	EUR	2.018	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(27)
19.04.2023	SGD	451.488	EUR	315.519	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.104)
19.04.2023	SGD	713.522	EUR	493.266	Absicherung	JP Morgan Chase New York	469
19.04.2023	USD	992	EUR	932	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
19.04.2023	SGD	5.157	EUR	3.602	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(33)
19.04.2023	GBP	2	EUR	2	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	323.910	EUR	303.201	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.381)
19.04.2023	GBP	106.908	EUR	121.876	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(290)
19.04.2023	GBP	26.847	EUR	30.605	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(73)
19.04.2023	GBP	222	EUR	251	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	USD	15.706.533	EUR	14.601.177	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(159.744)
19.04.2023	SGD	28.407.605	EUR	19.621.848	Absicherung	JP Morgan Chase New York	35.313
19.04.2023	GBP	16.172	EUR	18.287	Absicherung	JP Morgan Chase New York	105
19.04.2023	EUR	508.777	SGD	734.373	Absicherung	JP Morgan Chase New York	615
							EUR (185.379)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	347.933	CHF	338.989	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.050
19.04.2023	EUR	27	CHF	26	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	CHF	63	EUR	63	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	CHF	220.729	EUR	222.523	Absicherung	JP Morgan Chase New York	87
19.04.2023	CHF	17	EUR	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	CHF	2.886	EUR	2.954	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
19.04.2023	CHF	10.158.559	EUR	10.398.326	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(153.205)
19.04.2023	CHF	770	EUR	788	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
19.04.2023	EUR	99	CHF	96	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
							EUR (147.122)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	100	USD	106	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
19.04.2023	GBP	151.939	USD	184.881	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.058
19.04.2023	USD	7.402	EUR	6.893	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(95)
19.04.2023	EUR	96	USD	104	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	EUR	1.000	USD	1.081	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
19.04.2023	EUR	99	USD	106	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	EUR	1.233.313	USD	1.326.679	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14.675
19.04.2023	EUR	4.285.314	USD	4.609.726	Absicherung	JP Morgan Chase New York	50.990
19.04.2023	EUR	10.000	USD	10.745	Absicherung	JP Morgan Chase New York	131
							USD 68.771

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Technology die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	USD	22.564	EUR	20.999	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(274)
19.04.2023	EUR	49.131	USD	53.627	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(192)
19.04.2023	EUR	648.613	USD	707.967	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.534)
19.04.2023	EUR	990.785	USD	1.081.451	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.871)
19.04.2023	EUR	128.597	USD	140.365	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(502)
19.04.2023	CHF	844.103	USD	929.423	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.553)
19.04.2023	CHF	26.201	USD	28.421	Absicherung	JP Morgan Chase New York	318
19.04.2023	USD	550.640	EUR	513.784	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8.145)
19.04.2023	USD	17.161	EUR	15.830	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(56)
19.04.2023	USD	760	EUR	704	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
19.04.2023	USD	23.542	EUR	22.130	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(526)
19.04.2023	USD	35.436	EUR	33.310	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(791)
19.04.2023	USD	30.163	EUR	28.353	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(673)
19.04.2023	USD	86.807	EUR	81.599	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.938)
19.04.2023	USD	59	EUR	55	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	USD	82.653	EUR	76.209	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(231)
19.04.2023	USD	44.555	EUR	41.081	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(125)
19.04.2023	USD	342.241	EUR	316.722	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.225)
19.04.2023	USD	187.617	EUR	173.628	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.220)
19.04.2023	USD	18.383	EUR	17.420	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(562)
19.04.2023	USD	282	EUR	259	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	USD	1.873	EUR	1.736	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	661	USD	722	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
19.04.2023	USD	19.604	EUR	18.163	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(149)
19.04.2023	EUR	2.605	USD	2.846	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
19.04.2023	EUR	4.754.827	USD	5.114.783	Absicherung	JP Morgan Chase New York	56.577
19.04.2023	USD	1.989	EUR	1.851	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24)
19.04.2023	USD	41.994	EUR	39.039	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(465)
19.04.2023	EUR	60.000	USD	64.763	Absicherung	JP Morgan Chase New York	493
19.04.2023	EUR	32.209	USD	34.766	Absicherung	JP Morgan Chase New York	265
19.04.2023	EUR	31.219	USD	34.043	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(89)
19.04.2023	EUR	1.815.686	USD	1.953.139	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21.604
19.04.2023	EUR	391	USD	412	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
19.04.2023	EUR	1.401	USD	1.511	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
19.04.2023	EUR	2.927	USD	3.144	Absicherung	JP Morgan Chase New York	40
19.04.2023	EUR	20.905	USD	22.292	Absicherung	JP Morgan Chase New York	445
19.04.2023	EUR	11.659	USD	12.432	Absicherung	JP Morgan Chase New York	248
19.04.2023	EUR	5.075	USD	5.484	Absicherung	JP Morgan Chase New York	36
19.04.2023	EUR	1.771	USD	1.920	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	EUR	1.500.000	USD	1.616.372	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15.031
19.04.2023	EUR	212.886	USD	229.402	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.133
19.04.2023	EUR	56.004	USD	59.829	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.081
19.04.2023	EUR	768.115	USD	820.577	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14.827
19.04.2023	EUR	1.127.730	USD	1.204.752	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21.769
19.04.2023	EUR	145.919	USD	155.885	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.817
19.04.2023	EUR	23.318.799	USD	25.084.107	Absicherung	JP Morgan Chase New York	277.465
19.04.2023	EUR	36.786.443	USD	39.571.295	Absicherung	JP Morgan Chase New York	437.714
19.04.2023	EUR	5.792	USD	6.230	Absicherung	JP Morgan Chase New York	69
19.04.2023	CHF	22.197	USD	24.338	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
							USD 824.792

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - UK Equities die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	1.166	GBP	1.032	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
19.04.2023	EUR	857	GBP	757	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
19.04.2023	EUR	13.777	GBP	12.179	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(66)
19.04.2023	CHF	933	GBP	844	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
19.04.2023	EUR	850	GBP	751	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
19.04.2023	GBP	50.968	EUR	57.891	Absicherung	JP Morgan Chase New York	66
19.04.2023	GBP	2.379	CHF	2.632	Absicherung	JP Morgan Chase New York	45
19.04.2023	GBP	93.595	USD	113.901	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.512
19.04.2023	GBP	20	EUR	23	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	23	CHF	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	23	USD	28	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	20	EUR	23	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	20	EUR	23	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	23	CHF	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	23	USD	28	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	GBP	14.936	USD	18.177	Absicherung	JP Morgan Chase New York	241
19.04.2023	GBP	8.545	EUR	9.677	Absicherung	JP Morgan Chase New York	37
19.04.2023	GBP	4.872	EUR	5.550	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
19.04.2023	GBP	2.569	EUR	2.918	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
19.04.2023	GBP	6.800	EUR	7.746	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
19.04.2023	EUR	48.448	GBP	42.652	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(53)
19.04.2023	CHF	942	GBP	853	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
19.04.2023	EUR	856	GBP	757	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
19.04.2023	CHF	943	GBP	854	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
19.04.2023	EUR	82.304	GBP	72.756	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(389)
19.04.2023	CHF	41.344	GBP	37.414	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(752)
19.04.2023	EUR	2.929	GBP	2.586	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
19.04.2023	GBP	22.214	EUR	25.231	Absicherung	JP Morgan Chase New York	29
19.04.2023	EUR	180	GBP	158	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	95.945	GBP	84.221	Absicherung	JP Morgan Chase New York	141
19.04.2023	EUR	105.860	GBP	93.358	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(278)
19.04.2023	EUR	21.226	GBP	18.687	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
19.04.2023	EUR	52.333	GBP	46.072	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(57)
19.04.2023	EUR	116.692	GBP	102.732	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(128)
19.04.2023	CHF	1.510	GBP	1.336	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	EUR	366	GBP	322	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	1.308	GBP	1.148	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	GBP	1.004	CHF	1.111	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
19.04.2023	GBP	1.994	CHF	2.206	Absicherung	JP Morgan Chase New York	38
19.04.2023	GBP	202.165	EUR	229.627	Absicherung	JP Morgan Chase New York	261
19.04.2023	CHF	20	GBP	18	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	26	GBP	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	5.001	GBP	4.411	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
19.04.2023	EUR	200	GBP	177	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	EUR	1.989	GBP	1.758	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
19.04.2023	EUR	2.162.449	GBP	1.911.591	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10.211)
19.04.2023	EUR	92.948	GBP	81.483	Absicherung	JP Morgan Chase New York	244
19.04.2023	EUR	19	GBP	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	679.278	GBP	558.245	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9.083)
19.04.2023	CHF	72.304	GBP	65.431	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.315)
19.04.2023	EUR	5.061.591	GBP	4.474.414	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23.901)
19.04.2023	EUR	2.394.501	GBP	2.116.723	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11.307)
19.04.2023	CHF	98.050	GBP	88.729	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.783)
19.04.2023	EUR	221	GBP	194	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	230	GBP	201	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	EUR	2.095	GBP	1.852	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
19.04.2023	EUR	942.098	GBP	832.809	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.449)
19.04.2023	EUR	1.591	GBP	1.400	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
19.04.2023	USD	26	GBP	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	19	GBP	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	56.591	EUR	64.278	Absicherung	JP Morgan Chase New York	73
19.04.2023	GBP	8.283	USD	10.135	Absicherung	JP Morgan Chase New York	89
19.04.2023	GBP	845	EUR	963	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	GBP	23	CHF	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	GBP	23	USD	28	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	16.509	GBP	13.316	Absicherung	JP Morgan Chase New York	31
19.04.2023	USD	1.061	GBP	872	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
19.04.2023	CHF	20	GBP	18	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	1.061	GBP	872	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
19.04.2023	USD	1.053	GBP	865	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
19.04.2023	EUR	1.721	GBP	1.515	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
19.04.2023	CHF	2.099	GBP	1.856	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	USD	103.762	GBP	83.695	Absicherung	JP Morgan Chase New York	192
19.04.2023	EUR	19	GBP	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	CHF	20	GBP	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	26	GBP	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	4.258.892	GBP	3.500.044	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(56.947)
19.04.2023	CHF	882	GBP	780	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
							GBP (117.886)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - UK Equity Income die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	GBP	67.291	USD	81.890	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.087
19.04.2023	USD	27	GBP	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	24.580	GBP	19.826	Absicherung	JP Morgan Chase New York	45
19.04.2023	USD	1.052.732	GBP	865.156	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14.076)
19.04.2023	USD	3.012.171	GBP	2.475.463	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(40.275)
19.04.2023	USD	67.571	GBP	54.503	Absicherung	JP Morgan Chase New York	125
19.04.2023	USD	695	GBP	561	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	USD	29.287	GBP	24.069	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(392)
19.04.2023	CHF	2.562	GBP	2.266	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
19.04.2023	CHF	124.069	GBP	112.276	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.256)
19.04.2023	CHF	1.567	GBP	1.386	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	CHF	12.718	GBP	11.248	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30
19.04.2023	CHF	20	GBP	18	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	CHF	75.493	GBP	68.317	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.373)
19.04.2023	USD	949.810	GBP	780.573	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12.700)
19.04.2023	CHF	613.512	GBP	555.195	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11.155)
19.04.2023	EUR	105.044	GBP	92.087	Absicherung	JP Morgan Chase New York	275
19.04.2023	GBP	72.380	EUR	82.212	Absicherung	JP Morgan Chase New York	93
19.04.2023	EUR	10.000	GBP	8.803	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
19.04.2023	EUR	1.487.061	GBP	1.314.553	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7.022)
19.04.2023	EUR	54.719	GBP	48.371	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(258)
19.04.2023	EUR	259.437	GBP	229.340	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.225)
19.04.2023	EUR	442.546	GBP	391.207	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.090)
19.04.2023	EUR	115.301	GBP	101.925	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(544)
19.04.2023	EUR	279.194	GBP	246.806	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.318)
19.04.2023	EUR	40.814	GBP	35.932	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(45)
19.04.2023	EUR	1.908.854	GBP	1.687.415	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9.014)
19.04.2023	EUR	1.548.705	GBP	1.369.045	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7.313)

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	33.572	GBP	29.556	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(37)
19.04.2023	CHF	986	GBP	892	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
19.04.2023	EUR	20	GBP	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	1.983.784	GBP	1.630.314	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(26.525)
19.04.2023	USD	1.116	GBP	917	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
19.04.2023	GBP	36	SGD	58	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	10.429	EUR	11.846	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
19.04.2023	GBP	2.723	EUR	3.093	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	GBP	9.135	EUR	10.375	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
19.04.2023	GBP	31.655	USD	38.522	Absicherung	JP Morgan Chase New York	511
19.04.2023	GBP	37	USD	45	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	GBP	1.831	CHF	2.026	Absicherung	JP Morgan Chase New York	35
19.04.2023	GBP	35.681	USD	43.423	Absicherung	JP Morgan Chase New York	576
19.04.2023	GBP	24.074	CHF	26.633	Absicherung	JP Morgan Chase New York	456
19.04.2023	GBP	39	CHF	43	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	GBP	98.811	USD	120.250	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.596
19.04.2023	GBP	57.469	EUR	65.275	Absicherung	JP Morgan Chase New York	74
19.04.2023	GBP	973	USD	1.184	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16
19.04.2023	USD	22.452	GBP	18.110	Absicherung	JP Morgan Chase New York	41
19.04.2023	GBP	21	EUR	24	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	56.026	EUR	63.637	Absicherung	JP Morgan Chase New York	72
19.04.2023	EUR	10.000	GBP	8.840	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(48)
19.04.2023	EUR	30.255	GBP	26.636	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(33)
19.04.2023	EUR	1.142	GBP	1.006	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	EUR	5.627	GBP	4.954	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
19.04.2023	GBP	2.115	EUR	2.402	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
19.04.2023	GBP	220.882	USD	271.999	Absicherung	JP Morgan Chase New York	985
19.04.2023	GBP	140.733	USD	170.559	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.846
19.04.2023	GBP	49.596	EUR	56.303	Absicherung	JP Morgan Chase New York	90
19.04.2023	GBP	218.380	USD	269.316	Absicherung	JP Morgan Chase New York	651
19.04.2023	GBP	9.629	EUR	10.937	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
19.04.2023	GBP	4.888	CHF	5.407	Absicherung	JP Morgan Chase New York	93
19.04.2023	SGD	1.381	GBP	844	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
19.04.2023	GBP	9.836	EUR	11.126	Absicherung	JP Morgan Chase New York	53
19.04.2023	EUR	885	GBP	783	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
							GBP (127.950)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	1.463	USD	1.581	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
19.04.2023	GBP	4	USD	5	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	419.854	USD	451.638	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.996
19.04.2023	EUR	7.498	USD	7.913	Absicherung	JP Morgan Chase New York	242
19.04.2023	EUR	784	USD	844	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
19.04.2023	GBP	29.080	USD	35.385	Absicherung	JP Morgan Chase New York	585
19.04.2023	GBP	9.636	USD	11.726	Absicherung	JP Morgan Chase New York	194

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	100.205	USD	107.791	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.192
19.04.2023	EUR	2.401.859	USD	2.583.688	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28.580
19.04.2023	GBP	636.371	USD	774.343	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12.807
19.04.2023	GBP	8.427.539	USD	10.254.722	Absicherung	JP Morgan Chase New York	169.605
19.04.2023	USD	1.395.104	GBP	1.140.110	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15.133)
19.04.2023	USD	2.751	EUR	2.523	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
19.04.2023	USD	15.231	GBP	12.515	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(250)
19.04.2023	USD	233.065	GBP	191.513	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.823)
19.04.2023	USD	1.387.979	GBP	1.127.135	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.212)
19.04.2023	USD	707	EUR	665	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16)
19.04.2023	USD	810	GBP	666	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
19.04.2023	USD	9.416	EUR	8.922	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(288)
19.04.2023	USD	2.552	EUR	2.381	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(38)
19.04.2023	USD	60.053	EUR	55.729	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(558)
19.04.2023	USD	1.230	GBP	1.011	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
19.04.2023	USD	274.075	GBP	225.484	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.832)
19.04.2023	CHF	10.301	USD	11.342	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43)
19.04.2023	EUR	1.173	USD	1.260	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16
19.04.2023	EUR	1.800	USD	1.919	Absicherung	JP Morgan Chase New York	38
							USD 187.055

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	18	GBP	16	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	9.805	GBP	8.658	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
19.04.2023	EUR	181	GBP	158	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	EUR	41.179	GBP	36.099	Absicherung	JP Morgan Chase New York	124
19.04.2023	USD	1.915.217	EUR	1.780.432	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19.479)
19.04.2023	EUR	39.277	GBP	34.431	Absicherung	JP Morgan Chase New York	118
19.04.2023	EUR	748	GBP	657	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	EUR	369	GBP	324	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	EUR	121.261	GBP	106.301	Absicherung	JP Morgan Chase New York	365
19.04.2023	GBP	23	EUR	26	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	76.164	EUR	86.159	Absicherung	JP Morgan Chase New York	463
19.04.2023	GBP	690	EUR	781	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	GBP	1.512.411	EUR	1.710.884	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9.188
19.04.2023	GBP	1.743.077	EUR	1.971.821	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10.589
19.04.2023	GBP	4.598.592	EUR	5.202.065	Absicherung	JP Morgan Chase New York	27.937
19.04.2023	EUR	36.458	USD	39.144	Absicherung	JP Morgan Chase New York	467
19.04.2023	GBP	11.355	EUR	12.845	Absicherung	JP Morgan Chase New York	69
19.04.2023	GBP	228	EUR	260	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	EUR	17.168	GBP	15.098	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
19.04.2023	EUR	19	GBP	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	29	GBP	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	533	GBP	468	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	EUR	2.004	GBP	1.757	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	73.002	GBP	64.177	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
19.04.2023	EUR	291	GBP	255	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	EUR	4.148	GBP	3.636	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
19.04.2023	EUR	40	GBP	35	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	11.606	GBP	10.260	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(63)
19.04.2023	EUR	699	GBP	616	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	EUR	586	GBP	514	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	EUR	35	GBP	31	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	33	GBP	29	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	31.708	GBP	27.963	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(95)
19.04.2023	EUR	687	GBP	607	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
19.04.2023	EUR	838	GBP	741	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
19.04.2023	EUR	487	GBP	429	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	EUR	11	GBP	10	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	134	GBP	118	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	868	GBP	767	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
19.04.2023	GBP	477	EUR	542	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
05.04.2023	GBP	558.443	EUR	636.598	Handel	NatWest Markets	(1.154)
05.04.2023	USD	459.539	EUR	431.317	Handel	NatWest Markets	(8.451)
05.04.2023	GBP	475.087	EUR	538.804	Handel	JP Morgan	1.790
05.04.2023	GBP	525.043	EUR	597.664	Handel	Lloyds	(225)
05.04.2023	GBP	500.000	EUR	569.352	Handel	Barclays	(410)
05.04.2023	GBP	3.097.510	EUR	3.518.542	Handel	JP Morgan	6.068
05.04.2023	USD	674.753	EUR	628.802	Handel	Lloyds	(7.898)
05.04.2023	EUR	323.329	USD	346.198	Handel	NatWest Markets	4.760
05.04.2023	GBP	500.000	EUR	570.671	Handel	JP Morgan	(1.729)
05.04.2023	EUR	256.942	GBP	227.755	Handel	Barclays	(2.218)
05.04.2023	USD	3.766.280	EUR	3.479.198	Handel	NatWest Markets	(13.485)
05.04.2023	USD	428.278	EUR	395.637	Handel	NatWest Markets	(1.537)
05.04.2023	USD	221.532	EUR	205.729	Handel	Lloyds	(1.876)
05.04.2023	USD	2.525.661	EUR	2.350.026	Handel	JP Morgan	(25.925)
05.04.2023	EUR	640.613	GBP	562.834	Handel	JP Morgan	174
05.04.2023	EUR	97.330.858	GBP	86.517.536	Handel	JP Morgan	(1.116.238)
05.04.2023	EUR	1.688.212	GBP	1.500.000	Handel	NatWest Markets	(18.617)
05.04.2023	GBP	220.795	EUR	251.751	Handel	Lloyds	(512)
05.04.2023	GBP	1.500.000	EUR	1.702.779	Handel	JP Morgan	4.049
05.04.2023	EUR	247.518	USD	265.472	Handel	NatWest Markets	3.233
05.04.2023	EUR	249.556	USD	269.349	Handel	JP Morgan	1.703
05.04.2023	EUR	72.230.562	USD	76.672.995	Handel	JP Morgan	1.676.871
05.04.2023	EUR	671.693	USD	719.090	Handel	Goldman Sachs	9.992
05.04.2023	USD	250.000	EUR	233.513	Handel	JP Morgan	(3.465)
05.04.2023	USD	286.219	EUR	263.459	Handel	Citigroup Global Markets	(82)
05.04.2023	GBP	324.233	EUR	368.392	Handel	JP Morgan	548
05.04.2023	USD	1.415.553	EUR	1.332.336	Handel	Lloyds	(29.752)
05.04.2023	EUR	592.886	USD	645.838	Handel	JP Morgan	(1.411)
05.04.2023	GBP	482.993	EUR	546.093	Handel	NatWest Markets	3.498
							EUR 507.363

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
04.05.2023	EUR	4.288.956	GBP	3.772.347	Handel	JP Morgan	1.021
04.05.2023	EUR	3.675.473	USD	4.006.616	Handel	Citigroup Global Markets	(5.241)
19.04.2023	EUR	238.744	GBP	209.290	Absicherung	JP Morgan Chase New York	718
19.04.2023	EUR	12	NOK	132	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	11	NOK	124	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	14	GBP	12	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	14	GBP	12	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	14	GBP	12	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	14	GBP	12	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	11	GBP	10	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	11	GBP	10	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	11	GBP	10	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	14	GBP	12	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	167.603	GBP	147.457	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(101)
19.04.2023	USD	986	EUR	917	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
19.04.2023	EUR	11	GBP	10	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	11	GBP	10	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	NOK	8.408	EUR	744	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
19.04.2023	NOK	8.292	EUR	734	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
19.04.2023	SEK	8.185	EUR	721	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
19.04.2023	GBP	716	EUR	810	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	USD	981	EUR	912	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
19.04.2023	GBP	704	EUR	797	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	CHF	868	EUR	889	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
19.04.2023	EUR	13	NOK	144	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	12	SEK	133	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	13	NOK	145	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	16	USD	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	710	EUR	803	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	USD	6.039	EUR	5.614	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(61)
19.04.2023	CHF	872	EUR	892	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
19.04.2023	GBP	709	EUR	802	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	EUR	15	CHF	15	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	24	CHF	24	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	12	CHF	12	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	13	SEK	140	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	16	USD	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	96	USD	104	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	USD	984	EUR	915	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
19.04.2023	EUR	25	USD	26	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	10	USD	11	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	10	USD	11	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	977	EUR	908	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
19.04.2023	EUR	10	USD	11	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	16	USD	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	977	EUR	908	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
19.04.2023	GBP	12.396.179	EUR	14.022.928	Absicherung	JP Morgan Chase New York	75.309

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	10	USD	11	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	67	USD	72	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	EUR	16	USD	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	714	EUR	808	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
04.04.2023	GBP	43.608	EUR	49.712	Handel	JP Morgan	(89)
04.04.2023	USD	146.655	EUR	138.049	Handel	JP Morgan	(3.090)
04.04.2023	GBP	150.000	EUR	170.569	Handel	Citigroup Global Markets	120
04.04.2023	GBP	27.225	EUR	31.020	Handel	Barclays	(39)
04.04.2023	USD	268.470	EUR	253.140	Handel	JP Morgan	(6.079)
04.04.2023	USD	180.512	EUR	167.967	Handel	JP Morgan	(1.850)
04.04.2023	USD	30.181	EUR	28.330	Handel	Citigroup Global Markets	(555)
04.04.2023	USD	43.622	EUR	40.657	Handel	JP Morgan	(514)
04.04.2023	GBP	25.741	EUR	29.303	Handel	Barclays	(12)
04.04.2023	USD	200.000	EUR	185.463	Handel	Citigroup Global Markets	(1.412)
04.04.2023	GBP	573.820	EUR	654.911	Handel	JP Morgan	(1.945)
04.04.2023	GBP	25.761	EUR	29.187	Handel	JP Morgan	126
04.04.2023	EUR	36.137	GBP	31.748	Handel	JP Morgan	10
04.04.2023	EUR	5.569.729	GBP	4.936.754	Handel	Barclays	(47.952)
04.04.2023	USD	257.670	EUR	237.724	Handel	Citigroup Global Markets	(603)
04.04.2023	EUR	39.368	USD	42.882	Handel	JP Morgan	(94)
04.04.2023	EUR	28.347	USD	30.399	Handel	Barclays	372
04.04.2023	EUR	4.767.226	USD	5.101.861	Handel	Barclays	72.235
04.04.2023	GBP	250.000	EUR	284.681	Handel	JP Morgan	(199)
04.04.2023	GBP	100.000	EUR	113.880	Handel	Barclays	(87)
04.04.2023	USD	41.416	EUR	38.262	Handel	Barclays	(149)
							EUR 79.781

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	255.062	GBP	225.484	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.382)
19.04.2023	EUR	23	USD	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	CHF	927	EUR	949	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
19.04.2023	CHF	19	EUR	19	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	22	EUR	20	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	3.588	EUR	4.084	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
19.04.2023	USD	1.047	EUR	974	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
19.04.2023	GBP	175.074	EUR	198.049	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.064
19.04.2023	GBP	9.445.688	EUR	10.685.244	Absicherung	JP Morgan Chase New York	57.383
19.04.2023	GBP	767	EUR	867	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	GBP	190.937	EUR	217.283	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(129)
19.04.2023	GBP	16	EUR	18	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	476	EUR	538	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
19.04.2023	EUR	4.109	GBP	3.617	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
19.04.2023	EUR	372.042	GBP	327.549	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(481)
19.04.2023	EUR	1.694.815	GBP	1.496.617	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7.299)
19.04.2023	EUR	771.282	GBP	678.293	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(144)

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEVISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	1.534.343	GBP	1.350.728	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.849)
19.04.2023	EUR	21	GBP	18	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	27	CHF	26	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
							EUR 47.139

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	4.356	USD	4.686	Absicherung	JP Morgan Chase New York	52
19.04.2023	EUR	36.265	USD	38.742	Absicherung	JP Morgan Chase New York	700
19.04.2023	EUR	264	USD	282	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	EUR	90	USD	97	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	EUR	663	USD	700	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21
19.04.2023	EUR	1.738.552	USD	1.870.166	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20.686
19.04.2023	EUR	12.664	USD	13.623	Absicherung	JP Morgan Chase New York	151
19.04.2023	USD	5	EUR	5	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
							USD 21.617

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	EUR	14	USD	16	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	3.284	USD	3.565	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
19.04.2023	EUR	614	USD	661	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
19.04.2023	EUR	140.057	USD	150.660	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.666
19.04.2023	EUR	14	USD	15	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	3.194	USD	3.412	Absicherung	JP Morgan Chase New York	62
19.04.2023	USD	14	EUR	13	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	3.250	EUR	3.033	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(48)
							USD 1.694

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	USD	864	EUR	805	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
19.04.2023	EUR	116.664	USD	126.282	Absicherung	JP Morgan Chase New York	601
19.04.2023	GBP	22	USD	27	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	2.395.600	USD	2.914.992	Absicherung	JP Morgan Chase New York	48.211
19.04.2023	GBP	843.534	USD	1.026.421	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16.976
19.04.2023	GBP	47.385.733	USD	57.659.481	Absicherung	JP Morgan Chase New York	953.639
19.04.2023	GBP	17.384	USD	21.437	Absicherung	JP Morgan Chase New York	66
19.04.2023	GBP	956.990	USD	1.180.093	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.642

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	GBP	48.557	USD	59.877	Absicherung	JP Morgan Chase New York	185
19.04.2023	GBP	400	USD	487	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
19.04.2023	GBP	2.150	USD	2.606	Absicherung	JP Morgan Chase New York	54
19.04.2023	GBP	343	USD	420	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
19.04.2023	GBP	3.431	USD	4.197	Absicherung	JP Morgan Chase New York	47
19.04.2023	GBP	100	USD	123	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	GBP	25	USD	31	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	GBP	1.153	USD	1.428	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
19.04.2023	GBP	2.421	USD	2.969	Absicherung	JP Morgan Chase New York	26
19.04.2023	SGD	7.920	USD	5.943	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17
19.04.2023	SGD	5.272.279	USD	3.917.014	Absicherung	JP Morgan Chase New York	50.829
19.04.2023	SGD	94.304	USD	71.040	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(68)
19.04.2023	EUR	32.952	USD	35.668	Absicherung	JP Morgan Chase New York	170
19.04.2023	EUR	7.480	USD	8.032	Absicherung	JP Morgan Chase New York	103
19.04.2023	EUR	99	USD	107	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	EUR	98	USD	106	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	USD	50.723	SGD	67.553	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(116)
19.04.2023	USD	33.673	SGD	45.052	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(232)
19.04.2023	USD	55.292	GBP	45.086	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(476)
19.04.2023	USD	1.220	GBP	1.000	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
19.04.2023	CHF	1.797.125	USD	1.978.774	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7.564)
19.04.2023	CHF	33.384	USD	36.483	Absicherung	JP Morgan Chase New York	135
19.04.2023	CHF	19	USD	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	CHF	1.018	USD	1.120	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
19.04.2023	EUR	500	USD	540	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	USD	2.584	SGD	3.429	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
19.04.2023	EUR	2.490	USD	2.655	Absicherung	JP Morgan Chase New York	53
19.04.2023	EUR	1.198	USD	1.264	Absicherung	JP Morgan Chase New York	39
19.04.2023	EUR	1.631.693	USD	1.755.217	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19.415
19.04.2023	EUR	5.754.192	USD	6.189.803	Absicherung	JP Morgan Chase New York	68.468
19.04.2023	EUR	60.379	USD	65.357	Absicherung	JP Morgan Chase New York	311
19.04.2023	EUR	3.279	USD	3.550	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17
19.04.2023	EUR	1.000	USD	1.084	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
19.04.2023	EUR	161.334	USD	173.548	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.920
19.04.2023	EUR	298	USD	321	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	EUR	2.062	USD	2.219	Absicherung	JP Morgan Chase New York	25
19.04.2023	EUR	3.014.174	USD	3.242.356	Absicherung	JP Morgan Chase New York	35.865
19.04.2023	USD	95.679	SGD	128.814	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.264)
19.04.2023	USD	11.812	SGD	15.800	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(79)
19.04.2023	USD	1.869	SGD	2.516	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24)
19.04.2023	USD	964	GBP	782	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
19.04.2023	USD	136	GBP	110	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	12.525	GBP	10.404	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(344)
19.04.2023	USD	8.170	GBP	6.786	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(224)
19.04.2023	USD	2.076	GBP	1.724	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(57)
19.04.2023	USD	148	GBP	122	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
19.04.2023	USD	657	GBP	533	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
19.04.2023	USD	240	GBP	195	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	USD	513	GBP	418	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
19.04.2023	USD	11.255	GBP	9.250	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(186)
19.04.2023	USD	6.164	GBP	5.000	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21)
19.04.2023	USD	78.663	GBP	65.003	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.741)
19.04.2023	USD	1.525.629	GBP	1.260.702	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(33.766)
19.04.2023	USD	677	GBP	549	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
19.04.2023	USD	5.393	EUR	5.000	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(45)
19.04.2023	USD	8.568	EUR	7.943	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(71)
19.04.2023	USD	169.992	EUR	159.713	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.709)
19.04.2023	USD	48.432	EUR	45.504	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.057)
19.04.2023	USD	44.202	EUR	40.471	Absicherung	JP Morgan Chase New York	186
19.04.2023	USD	89.014	EUR	83.632	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.942)
19.04.2023	USD	9.985	GBP	8.183	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(137)
19.04.2023	USD	27.945	GBP	23.092	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(619)
19.04.2023	USD	1.807.032	GBP	1.486.657	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(31.856)
19.04.2023	USD	4.257	GBP	3.504	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(78)
19.04.2023	USD	33.633	SGD	45.433	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(558)
19.04.2023	USD	2.748	SGD	3.638	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
19.04.2023	USD	258.994	SGD	348.647	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.390)
19.04.2023	USD	11.551	SGD	15.376	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21)
19.04.2023	USD	115.539	SGD	155.211	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.270)
19.04.2023	USD	2.193	SGD	2.911	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
19.04.2023	USD	91.110	SGD	122.270	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(908)
19.04.2023	USD	31	CHF	28	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
19.04.2023	USD	981	CHF	901	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
19.04.2023	USD	1.067	GBP	878	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
19.04.2023	USD	53.997	CHF	49.766	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(589)
19.04.2023	USD	10.887	EUR	10.210	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(217)
19.04.2023	USD	4.766	EUR	4.478	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(104)
19.04.2023	USD	9.244	EUR	8.477	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24
19.04.2023	USD	4.519	EUR	4.144	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
19.04.2023	USD	19.690	EUR	18.056	Absicherung	JP Morgan Chase New York	52
19.04.2023	USD	8.488	EUR	7.900	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(103)
19.04.2023	USD	152	EUR	141	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
19.04.2023	USD	494	GBP	399	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
19.04.2023	USD	3.775	GBP	3.106	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(67)
19.04.2023	USD	52.245	CHF	48.114	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(528)
19.04.2023	USD	17.519	SGD	23.274	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
							USD 1.107.623

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Verkauf	EUR	1.300.000	20.06.2025	16.406	0,00
CDS	JPMorgan	Glencore International	Verkauf	EUR	1.100.000	20.06.2026	137.572	0,02
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Verkauf	EUR	1.770.000	20.12.2026	248.476	0,03
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	4.650.000	20.06.2027	41.686	0,00
CDS	JPMorgan	SSE plc	Kauf	EUR	1.400.000	20.06.2027	(30.170)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Kauf	EUR	1.200.000	20.06.2027	(1.715)	(0,00)
CDS	Barclays	Swedbank AB	Kauf	EUR	2.330.000	20.06.2027	(44.141)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	16.200.000	20.12.2027	(629.938)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Verkauf	USD	49.850.000	20.12.2027	576.905	0,07
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Kauf	USD	20.000.000	20.12.2027	(231.456)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	4.000.000	20.12.2027	155.540	0,02
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Kauf	EUR	4.740.000	20.12.2027	(38.288)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Kauf	EUR	3.000.000	20.12.2027	(66.281)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Kauf	EUR	4.000.000	20.12.2027	(106.106)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	580.000	20.12.2023	(13.076)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	200.000	20.12.2023	(4.509)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Verkauf	USD	22.000.000	20.12.2027	254.602	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	8.000.000	20.12.2027	80.854	0,01
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Verkauf	USD	11.000.000	20.12.2027	127.301	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	4.000.000	20.12.2027	40.427	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	9.500.000	20.12.2027	96.014	0,01
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Verkauf	USD	10.700.000	20.12.2027	123.829	0,01
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Kauf	USD	5.550.000	20.12.2027	(64.229)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Kauf	USD	18.000.000	20.12.2027	(208.311)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	38.000.000	20.12.2027	384.057	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	9.420.000	20.12.2027	95.206	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	31.080.000	20.12.2027	314.118	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	2.000.000	20.12.2027	(20.214)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	20.000.000	20.12.2027	(202.135)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Kauf	EUR	10.400.000	20.12.2027	(105.110)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Kauf	EUR	21.710.000	20.12.2027	(219.418)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Kauf	EUR	45.890.000	20.12.2027	(463.798)	(0,06)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Kauf	USD	8.000.000	20.12.2027	(92.582)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Kauf	USD	20.000.000	20.12.2027	(231.456)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Kauf	USD	22.000.000	20.12.2027	(254.602)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Verkauf	EUR	15.700.000	20.06.2028	125.756	0,02

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Kauf	EUR	10.810.000	20.06.2028	(305.221)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	12.200.000	20.12.2027	474.398	0,06
							USD (39.609)	(0,00)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	4.201.000	20.12.2027	(39.080)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	2.680.000	20.12.2027	(95.919)	(0,12)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	820.000	20.12.2027	(7.628)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	2.600.000	20.12.2027	(24.187)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	1.400.000	20.12.2027	13.024	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	3.900.000	20.12.2027	(36.280)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	5.500.000	20.12.2027	(51.164)	(0,06)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	1.700.000	20.12.2027	15.814	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Kauf	EUR	11.980.000	20.06.2028	(88.324)	(0,11)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	13.921.000	20.12.2027	129.501	0,16
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Kauf	EUR	2.370.000	20.06.2028	(61.593)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	2.680.000	20.12.2027	95.920	0,12
CDS	JPMorgan	Glencore International	Verkauf	EUR	400.000	20.06.2026	46.046	0,06
CDS	JPMorgan	Commerzbank	Verkauf	EUR	600.000	20.06.2027	6.269	0,01
CDS	Goldman Sachs	Airbus SE	Verkauf	EUR	600.000	20.06.2027	7.198	0,01
							EUR (90.403)	(0,11)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	325.000	20.12.2023	(6.744)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Verkauf	EUR	900.000	20.06.2025	10.454	0,01
CDS	JPMorgan	Glencore International	Verkauf	EUR	600.000	20.06.2026	69.069	0,05
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	1.700.000	20.06.2027	14.027	0,01
CDS	Barclays	Mercedes-Benz Group	Kauf	EUR	537.500	20.06.2027	(8.908)	(0,01)
CDS	JPMorgan	SSE plc	Kauf	EUR	1.870.000	20.06.2027	(37.092)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Kauf	EUR	800.000	20.06.2027	(1.053)	(0,00)
CDS	Barclays	Swedbank AB	Kauf	EUR	2.160.000	20.06.2027	(37.664)	(0,03)

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	26.200.000	20.12.2027	(937.723)	(0,69)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	32.524.466	20.12.2027	302.561	0,22
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	1.120.000	20.12.2027	(10.419)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	1.095.534	20.12.2027	10.191	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	3.700.000	20.12.2027	113.575	0,08
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	6.300.000	20.12.2027	(58.606)	(0,04)
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Kauf	EUR	590.000	20.12.2027	5.003	0,00
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Kauf	EUR	2.190.000	20.12.2027	(16.282)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	1.750.000	20.12.2027	62.634	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	1.000.000	20.12.2027	35.791	0,03
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Kauf	EUR	1.750.000	20.12.2027	(35.587)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Kauf	EUR	1.700.000	20.12.2027	(41.507)	(0,03)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Kauf	USD	800.000	20.06.2023	(7.136)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	600.000	20.12.2027	21.475	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	2.250.000	20.12.2027	80.530	0,06
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	1.000.000	20.12.2027	35.791	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	600.000	20.12.2027	21.475	0,02
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Verkauf	EUR	580.000	20.12.2027	(56.599)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	800.000	20.12.2027	28.633	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	550.000	20.12.2027	19.685	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	1.500.000	20.12.2027	53.686	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	1.800.000	20.12.2027	64.424	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	6.000.000	20.12.2027	(55.815)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	5.200.000	20.12.2027	(48.373)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	4.000.000	20.12.2027	(37.210)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	900.000	20.12.2027	32.212	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	4.200.000	20.12.2027	(39.071)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Kauf	EUR	11.920.000	20.06.2028	(309.782)	(0,23)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	13.450.000	20.12.2027	481.388	0,35
							EUR (282.967)	(0,22)

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	2.080.000	20.12.2027	80.881	0,23
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Verkauf	USD	3.340.000	20.12.2027	38.653	0,11
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.40	Verkauf	USD	3.340.000	20.06.2028	37.908	0,11
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Kauf	USD	3.340.000	20.12.2027	(38.653)	(0,11)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	2.080.000	20.12.2027	(80.881)	(0,23)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Verkauf	EUR	2.080.000	20.06.2028	58.729	0,16
							USD 96.637	0,27

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	230.000	20.12.2027	(8.944)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	640.000	20.12.2027	6.468	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	640.000	20.12.2027	(6.468)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Verkauf	EUR	555.467	20.06.2028	4.449	0,00
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Verkauf	USD	300.000	20.12.2027	3.472	0,00
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Verkauf	USD	500.000	20.12.2027	5.786	0,01
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Kauf	EUR	130.000	20.12.2027	(1.050)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	200.000	20.12.2027	(2.021)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Kauf	USD	500.000	20.12.2027	(5.786)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	400.000	20.12.2027	(4.043)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Kauf	EUR	70.000	20.12.2027	(1.547)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Kauf	EUR	90.000	20.12.2027	(2.387)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	100.000	20.12.2023	(3.656)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Verkauf	EUR	40.000	20.12.2026	5.615	0,01
CDS	JPMorgan	SSE plc	Kauf	EUR	70.000	20.06.2027	(1.508)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	250.000	20.12.2027	(2.527)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	200.000	20.12.2027	2.021	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	300.000	20.12.2027	3.032	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	300.000	20.12.2027	(3.032)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	650.000	20.12.2027	6.569	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	150.000	20.12.2027	1.516	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	280.000	20.12.2027	2.830	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	340.000	20.12.2027	(3.436)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Kauf	USD	300.000	20.12.2027	(3.472)	(0,00)

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	90.000	20.12.2027	(910)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Kauf	EUR	200.000	20.06.2028	(5.645)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	230.000	20.12.2027	8.944	0,01
							USD (5.730)	(0,01)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	Bank of America Merrill Lynch	Nordamerika Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 8 Aktien und Erhalt des SOFR.	USD	1.168.600	20.04.2023	(41.776)	(0,21)
TRS	UBS	Nordamerika Aktienkorb	Zahlung von SOFR und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 6 Aktien. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 37 Aktien und Erhalt des SOFR.	USD	6.499.476	26.06.2023	(221.525)	(1,13)
							USD (263.301)	(1,34)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
CDS	Goldman Sachs	Arcelormittal	Kauf	EUR	7.500.000	20.12.2023	(230.831)	(0,05)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Verkauf	EUR	3.950.000	20.06.2025	45.883	0,01
CDS	JPMorgan	Societe Generale SA	Kauf	EUR	19.000.000	20.12.2026	15.073	0,00
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Verkauf	EUR	4.000.000	20.12.2026	516.847	0,12
CDS	BNP Paribas	Monitech Holdco 3 S.A.	Kauf	EUR	10.000.000	20.06.2027	(670.461)	(0,16)
CDS	BNP Paribas	British Telecommunications plc	Kauf	EUR	15.000.000	20.06.2027	(40.054)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	8.600.000	20.06.2027	70.962	0,02
CDS	Citigroup Global Markets	BNP Paribas SA	Kauf	EUR	6.500.000	20.12.2027	115.867	0,03
CDS	Barclays	Mercedes-Benz Group	Kauf	EUR	19.355.000	20.06.2027	(320.764)	(0,07)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	122.080.000	20.12.2027	(4.369.356)	(1,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	17.840.000	20.12.2027	(59.007)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Kauf	USD	126.220.000	20.12.2027	(1.344.489)	(0,31)
CDS	Goldman Sachs	Bayerische Motoren Werke AG	Kauf	EUR	10.860.000	20.12.2027	(178.676)	(0,04)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Kauf	EUR	10.400.000	20.12.2027	(46.243)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	15.920.000	20.12.2027	488.679	0,11
CDS	Citigroup Global Markets	HSBC Holdings	Kauf	EUR	11.800.000	20.12.2027	123.803	0,03

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
CDS	Goldman Sachs	ING Groep NV	Kauf	EUR	6.170.000	20.12.2027	93.990	0,02
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Kauf	EUR	15.370.000	20.12.2027	130.342	0,03
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Kauf	EUR	13.390.000	20.12.2027	(99.552)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	4.430.000	20.12.2027	(53.723)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	13.400.000	20.12.2027	(479.598)	(0,11)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	7.260.000	20.12.2027	(222.853)	(0,05)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Kauf	EUR	10.000.000	20.12.2027	(203.355)	(0,05)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Kauf	EUR	10.000.000	20.12.2027	(244.158)	(0,06)
CDS	JPMorgan	Commerzbank	Verkauf	EUR	8.400.000	20.06.2027	87.769	0,02
CDS	Goldman Sachs	Faurecia Se	Verkauf	EUR	3.200.000	20.06.2027	202.512	0,05
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Kauf	EUR	9.700.000	20.06.2027	(12.763)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	164.000.000	21.06.2023	287.091	0,07
CDS	Barclays	Swedbank AB	Kauf	EUR	18.560.000	20.06.2027	(323.631)	(0,08)
CDS	Citigroup Global Markets	Westpac banking Corp.	Kauf	USD	17.000.000	20.06.2027	(225.512)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Kauf	USD	19.000.000	20.12.2027	(202.387)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Verkauf	USD	25.000.000	20.12.2027	266.299	0,06
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Verkauf	USD	10.000.000	20.12.2027	106.520	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	1.000.000	20.12.2027	35.791	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	14.110.000	20.12.2027	131.259	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Kauf	EUR	119.160.000	20.06.2028	(3.096.778)	(0,72)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	134.480.000	20.12.2027	4.813.164	1,12
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Kauf	EUR	14.470.000	20.06.2028	(7.734)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	17.840.000	20.12.2027	59.007	0,01
CDS	BNP Paribas	Unicredit SPA	Kauf	EUR	2.400.000	20.12.2027	3.109	0,00
							EUR (4.837.958)	(1,11)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Kauf	EUR	60.000	20.06.2023	(104)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Pearson PLC	Kauf	EUR	40.000	20.06.2023	(73)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banca Popolare Di Milano	Kauf	EUR	30.000	20.06.2023	(159)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues	Kauf	EUR	30.000	20.06.2023	(170)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Kauf	EUR	80.000	20.06.2023	(139)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Verkauf	EUR	350.000	20.06.2025	4.066	0,02
CDS	JPMorgan	Tescop plc	Kauf	EUR	60.000	20.06.2023	(104)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Societe Generale SA	Kauf	EUR	1.000.000	20.12.2026	793	0,00
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Verkauf	EUR	190.000	20.12.2026	24.550	0,14
CDS	Citigroup Global Markets	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	1.000.000	20.06.2027	8.251	0,05

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
CDS	Barclays	Mercedes-Benz Group	Kauf	EUR	797.500	20.06.2027	(13.217)	(0,07)
CDS	JPMorgan	Commerzbank	Verkauf	EUR	500.000	20.06.2027	5.224	0,03
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues	Kauf	EUR	30.000	20.06.2023	(170)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Kauf	EUR	580.000	20.06.2027	(763)	(0,00)
CDS	Barclays	Swedbank AB	Kauf	EUR	850.000	20.06.2027	(14.821)	(0,08)
CDS	Citigroup Global Markets	Westpac banking Corp.	Kauf	USD	1.420.000	20.06.2027	(18.837)	(0,11)
CDS	Citigroup Global Markets	BNP Paribas SA	Kauf	EUR	600.000	20.12.2027	10.695	0,06
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	2.640.000	20.12.2027	(94.488)	(0,53)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	1.010.000	20.12.2027	(3.341)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Kauf	USD	9.650.000	20.12.2027	(102.791)	(0,57)
CDS	JPMorgan	United Utilities Group	Kauf	EUR	80.000	20.12.2023	(514)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Bayerische Motoren Werke AG	Kauf	EUR	480.000	20.12.2027	(7.897)	(0,04)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Kauf	EUR	150.000	20.12.2027	(667)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	3.220.000	20.12.2027	98.841	0,55
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Verkauf	USD	1.150.000	20.12.2027	12.250	0,07
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	280.000	20.12.2027	926	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	240.000	20.12.2027	8.590	0,05
CDS	Citigroup Global Markets	HSBC Holdings	Kauf	EUR	720.000	20.12.2027	7.554	0,04
CDS	Goldman Sachs	ING Groep NV	Kauf	EUR	560.000	20.12.2027	8.531	0,05
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Kauf	EUR	910.000	20.12.2027	7.717	0,04
CDS	Goldman Sachs	Standard Chartered plc	Kauf	EUR	1.050.000	20.12.2027	(7.807)	(0,04)
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	200.000	20.12.2027	(2.425)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	440.000	20.12.2027	(13.506)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	300.000	20.12.2027	(9.209)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	250.000	20.12.2027	(7.674)	(0,04)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Kauf	EUR	480.000	20.12.2027	(9.761)	(0,05)
CDS	Goldman Sachs	Telia Co AB	Kauf	EUR	500.000	20.12.2027	(12.208)	(0,07)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	13.000.000	21.06.2023	22.757	0,13
CDS	Barclays	Natural Energy Group SA	Kauf	EUR	500.000	20.12.2027	(5.855)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	30.000	20.06.2023	(159)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	145.000	20.12.2023	(3.009)	(0,02)
CDS	Barclays	Tesco plc	Kauf	EUR	100.000	20.12.2023	(558)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Kauf	EUR	260.000	20.12.2023	(1.450)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	250.000	20.12.2023	(5.188)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Verkauf	USD	500.000	20.12.2027	5.326	0,03
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Verkauf	USD	800.000	20.12.2027	8.522	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Kauf	EUR	1.550.000	20.12.2027	(14.419)	(0,08)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	270.000	20.12.2027	9.664	0,05

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	80.000	20.12.2027	2.863	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	450.000	20.12.2027	4.186	0,02
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	100.000	20.12.2027	930	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	280.000	20.12.2027	2.605	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	1.000.000	20.12.2027	9.303	0,05
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Verkauf	USD	800.000	20.12.2027	8.522	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	150.000	20.12.2027	5.369	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSUB 38	Verkauf	EUR	500.000	20.12.2027	(15.348)	(0,09)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 38	Verkauf	EUR	130.000	20.12.2027	430	0,00
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	230.000	20.12.2027	8.232	0,05
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.39	Verkauf	USD	900.000	20.12.2027	9.587	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSUB 38	Verkauf	EUR	130.000	20.12.2027	(3.991)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	1.670.000	20.12.2027	59.771	0,33
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Kauf	EUR	1.480.000	20.06.2028	(38.463)	(0,22)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 39	Kauf	EUR	490.000	20.06.2028	(262)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 38	Verkauf	EUR	600.000	20.12.2027	1.985	0,01
							EUR (51.507)	(0,26)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	Goldman Sachs	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 4 Aktien und Erhalt des 1-M-EURIBOR.	EUR	982.939	vom 05.05.2027 bis zum 24.10.2029	(16.183)	(0,02)
TRS	Goldman Sachs	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie und Erhalt des 1M SONIA.	GBP	169.225	18.05.2029	(5.139)	(0,01)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 9 Aktien und Erhalt des CHF SARON 1M.	CHF	5.570.292	07.02.2024	(215.043)	(0,28)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 10 Aktien und Erhalt des 1M CIBOR.	DKK	73.558.815	07.02.2024	(266.150)	(0,34)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 34 Aktien und Erhalt des 1-M-EURIBOR.	EUR	23.560.734	07.02.2024	(787.916)	(1,01)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 3 Aktien und Erhalt des 1M NIBOR.	NOK	33.025.063	07.02.2024	44.968	0,06

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 2 Aktien und Erhalt des 1M SONIA.	GBP	2.046.162	06.12.2024	(93.878)	(0,12)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 12 Aktien und Erhalt des 1M STIBOR.	SEK	96.313.710	07.02.2024	(409.070)	(0,52)
							EUR (1.748.411)	(2,24)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
TRS	Bank of America Merrill Lynch	Nordamerika Aktienkorb	Zahlung von SOFR und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 2 Aktien. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 8 Aktien und Erhalt des SOFR.	USD	5.694.728	20.04.2023	(20.733)	(0,02)
TRS	UBS	Nordamerika Aktienkorb	Zahlung von SOFR und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 6 Aktien. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 36 Aktien und Erhalt des SOFR.	USD	23.966.928	26.06.2023	(549.776)	(0,62)
							USD (570.509)	(0,64)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie und Erhalt des AUD SWAP OIS 1M.	AUD	1.461.675	10.01.2025	(756)	(0,00)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung des 1M CDOR und Erhalt der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie.	CAD	990.444	03.06.2024	(71.338)	(0,09)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung des CHF SARON 1M und Erhalt der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie.	CHF	1.395.765	04.11.2024	93.999	0,12
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung des 1M CIBOR und Erhalt der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie.	DKK	5.864.700	10.01.2025	(227.335)	(0,28)

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung des 1M EURIBOR und Erhalt der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 4 Aktien und Erhalt des 1-M-EURIBOR.	EUR	2.357.649	10.01.2025	(9.707)	(0,01)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 2 Aktien und Erhalt des 1M SONIA.	GBP	1.016.948	10.01.2025	98.828	0,12
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung des SOFR und Erhalt der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie.	IDR	9.688.254.000	29.01.2026	(8.093)	(0,01)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung von 1M-TIBOR und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 2 Aktien. Zahlung der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie und Erhalt des 1M-TIBOR.	JPY	346.912.800	03.06.2024	35.133	0,04
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung des 1M STIBOR und Erhalt der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie. Zahlung der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie und Erhalt des 1M STIBOR.	SEK	17.192.546	10.01.2025	(71.957)	(0,09)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung des SOFR und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 18 Aktien. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 15 Aktien und Erhalt des SOFR.	USD	33.396.322	10.01.2025	1.015.006	1,25
							USD 853.780	1,05

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
TRS	Goldman Sachs	Nordamerika Rohstoffkorb	Zahlung von 0,11 % und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 2 Indizes.	USD	86.609.236	14.04.2023	1.086.000	0,54
TRS	JPMorgan	Nordamerika Rohstoffkorb	Zahlung von 0 % bis 0,58 % und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 33 Indizes. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 17 Indizes und Erhalt von 0 %.	USD	612.097.514	03.04.2023 bis 14.04.2023	523.994	0,26
TRS	Macquarie	Nordamerika Rohstoffkorb	Zahlung von 0,17 % und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 2 Indizes.	USD	47.581.150	14.04.2023	532.045	0,27
							USD 2.142.039	1,07

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

11 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

Zum 31. März 2023 ist der Kontrahent von ausstehenden Terminkontrakten UBS.

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-Bobl Future	Verkäufe	(88)	EUR	(9.473.469)	08.06.2023	(237.215)	(0,03)
Euro-OAT Future	Verkäufe	(58)	EUR	(5.866.675)	08.06.2023	(294.276)	(0,04)
Euro-Bund Future	Verkäufe	(111)	EUR	(11.439.851)	08.06.2023	(365.961)	(0,04)
Japan 10-Year Bond	Verkäufe	(13)	JPY	(9.669.461)	13.06.2023	(290.104)	(0,03)
Australian 10-Year Treasury Bond Future	Käufe	15	AUD	1.234.548	15.06.2023	37.600	0,00
Canada 10-Year Bond Future	Käufe	95	CAD	6.315.831	21.06.2023	358.415	0,04
Ultra 10-Year US Treasury Note	Verkäufe	(178)	USD	(18.656.625)	21.06.2023	(182.134)	(0,02)
US Treasury Note	Käufe	4	USD	443.250	21.06.2023	20.375	0,00
Ultra US Treasury Bond Future	Verkäufe	(10)	USD	(930.156)	21.06.2023	(10.000)	(0,00)
Long Gilt Future	Verkäufe	(176)	GBP	(23.088.538)	28.06.2023	(212.777)	(0,03)
5-Year US Treasury Note	Käufe	293	USD	29.782.992	30.06.2023	430.718	0,06
2-Year US Treasury Note	Käufe	16	USD	3.186.125	30.06.2023	36.250	0,00
						USD (709.109)	(0,09)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-Bund Future	Verkäufe	(1)	EUR	(94.861)	08.06.2023	(4.340)	(0,01)
Euro-Buxl Future	Verkäufe	(4)	EUR	(316.472)	08.06.2023	(38.080)	(0,05)
Euro-Bobl Future	Käufe	31	EUR	3.071.697	08.06.2023	79.290	0,11
Ultra 10-Year US Treasury Note	Verkäufe	(16)	USD	(1.543.559)	21.06.2023	(57.642)	(0,07)
US Treasury Note	Verkäufe	(3)	USD	(305.985)	21.06.2023	(14.124)	(0,02)
10-Year US Treasury Note	Verkäufe	(12)	USD	(1.121.773)	21.06.2023	(34.516)	(0,04)
Long Gilt Future	Verkäufe	(10)	GBP	(1.207.463)	28.06.2023	(23.698)	(0,03)
5-Year US Treasury Note	Verkäufe	(6)	USD	(561.361)	30.06.2023	(12.164)	(0,02)
						EUR (105.274)	(0,13)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond den folgenden ausstehenden Terminkontrakt:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
10-Year US Treasury Note	Verkäufe	(26)	USD	(2.430.508)	21.06.2023	(80.768)	(0,02)
						EUR (80.768)	(0,02)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - European Social Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Long-Term Euro-BTP Future	Verkäufe	(4)	EUR	(410.020)	08.06.2023	(18.400)	(0,01)

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

11 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

(Fortsetzung)

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-Bund Future	Verkäufe	(6)	EUR	(569.166)	08.06.2023	(30.900)	(0,01)
Short-Term Euro-BTP Future	Verkäufe	(1)	EUR	(96.961)	08.06.2023	(1.270)	(0,00)
Euro-Bobl Future	Verkäufe	(153)	EUR	(15.160.311)	08.06.2023	(317.520)	(0,08)
10-Year US Treasury Note	Verkäufe	(35)	USD	(3.271.837)	21.06.2023	(100.672)	(0,03)
Long Gilt Future	Verkäufe	(74)	GBP	(8.935.229)	28.06.2023	(197.222)	(0,06)
5-Year US Treasury Note	Verkäufe	(14)	USD	(1.309.842)	30.06.2023	(28.382)	(0,01)
2-Year US Treasury Note	Verkäufe	(3)	USD	(549.863)	30.06.2023	(6.256)	(0,00)
						EUR (700.622)	(0,20)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-Buxl Future	Verkäufe	(29)	EUR	(2.294.422)	08.06.2023	(279.560)	(0,21)
Euro-Bund Future	Käufe	82	EUR	7.778.602	08.06.2023	351.772	0,26
Euro-Schatz Future	Verkäufe	(4)	EUR	(398.184)	08.06.2023	(4.200)	(0,00)
Euro-Bobl Future	Verkäufe	(273)	EUR	(27.050.751)	08.06.2023	(552.660)	(0,41)
Japan 10-Year Bond	Verkäufe	(14)	JPY	(9.584.671)	13.06.2023	(286.592)	(0,21)
10-Year US Treasury Note	Käufe	19	USD	1.776.140	21.06.2023	7.924	0,01
US Treasury Note	Verkäufe	(15)	USD	(1.529.925)	21.06.2023	(72.052)	(0,05)
Ultra US Treasury Bond Future	Verkäufe	(37)	USD	(3.167.728)	21.06.2023	(171.344)	(0,13)
Ultra 10-Year US Treasury Note	Käufe	27	USD	2.604.756	21.06.2023	95.437	0,07
Long Gilt Future	Verkäufe	(15)	GBP	(1.811.195)	28.06.2023	17.061	0,01
5-Year US Treasury Note	Verkäufe	(46)	USD	(4.303.767)	30.06.2023	(136.612)	(0,10)
						EUR (1.030.826)	(0,76)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
10-Year US Treasury Note	Verkäufe	(41)	USD	(4.164.063)	21.06.2023	(131.328)	(0,22)
5-Year US Treasury Note	Käufe	79	USD	8.030.227	30.06.2023	175.281	0,29
						USD 43.953	0,07

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Topix Index Future	Käufe	11	JPY	1.655.909	08.06.2023	23.803	0,07
E-Mini RUSs 1000 V	Käufe	5	USD	378.050	16.06.2023	11.410	0,03
FTSE 100 Index Future	Käufe	24	GBP	2.266.858	16.06.2023	25.294	0,07
MSCI Emerging Markets Index	Käufe	9	USD	447.975	16.06.2023	16.900	0,05

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

11 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

(Fortsetzung)

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
E-mini S&P 500 Future	Verkäufe	(25)	USD	(5.172.188)	16.06.2023	(306.873)	(0,86)
Euro Stoxx 50 PR	Verkäufe	(37)	EUR	(1.712.864)	16.06.2023	(85.221)	(0,24)
						USD (314.687)	(0,88)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-OAT Future	Verkäufe	(1)	EUR	(101.150)	08.06.2023	(5.074)	(0,00)
Euro-Bobl Future	Verkäufe	(8)	EUR	(861.224)	08.06.2023	(16.612)	(0,02)
Euro-Bund Future	Verkäufe	(2)	EUR	(206.123)	08.06.2023	(11.190)	(0,01)
FTSE 100 Index Future	Käufe	8	GBP	755.619	16.06.2023	10.769	0,01
Euro Stoxx 50 PR	Käufe	32	EUR	1.481.396	16.06.2023	36.309	0,02
E-mini S&P 500 Future	Käufe	51	USD	10.551.263	16.06.2023	323.459	0,29
Canada 10-Year Bond Future	Käufe	2	CAD	132.965	21.06.2023	7.546	0,01
10-Year US Treasury Note	Käufe	2	USD	203.125	21.06.2023	6.234	0,01
US Treasury Note	Verkäufe	(1)	USD	(110.813)	21.06.2023	(5.219)	(0,00)
Ultra 10-Year US Treasury Note	Käufe	1	USD	104.813	21.06.2023	297	0,00
Long Gilt Future	Verkäufe	(3)	GBP	(393.555)	28.06.2023	(2.389)	(0,00)
5-Year US Treasury Note	Käufe	8	USD	813.188	30.06.2023	17.750	0,02
2-Year US Treasury Note	Käufe	2	USD	398.266	30.06.2023	4.531	0,00
						USD 366.411	0,33

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
E-mini S&P 500 Future	Verkäufe	(50)	USD	(10.344.375)	16.06.2023	(613.670)	(3,12)
						USD (613.670)	(3,12)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-OAT Future	Verkäufe	(187)	EUR	(17.409.887)	08.06.2023	(873.290)	(0,20)
Euro-Buxl Future	Verkäufe	(37)	EUR	(2.927.366)	08.06.2023	(352.240)	(0,08)
Euro-Bund Future	Verkäufe	(170)	EUR	(16.126.370)	08.06.2023	(873.400)	(0,20)
Euro-Bobl Future	Verkäufe	(833)	EUR	(82.539.471)	08.06.2023	(2.290.749)	(0,54)
Japan 10-Year Bond	Verkäufe	(31)	JPY	(21.223.200)	13.06.2023	(636.741)	(0,15)
10-Year US Treasury Note	Verkäufe	(41)	USD	(3.832.724)	21.06.2023	(117.930)	(0,03)
US Treasury Note	Verkäufe	(13)	USD	(1.325.935)	21.06.2023	(61.206)	(0,01)
Ultra US Treasury Bond Future	Verkäufe	(15)	USD	(1.284.214)	21.06.2023	3.794	0,00

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

11 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

(Fortsetzung)

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Ultra 10-Year US Treasury Note	Verkäufe	(37)	USD	(3.569.481)	21.06.2023	(133.296)	(0,03)
Long Gilt Future	Verkäufe	(260)	GBP	(31.394.049)	28.06.2023	(669.492)	(0,16)
5-Year US Treasury Note	Käufe	205	USD	19.179.833	30.06.2023	418.651	0,10
						EUR (5.585.899)	(1,30)

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-Buxl Future	Verkäufe	(2)	EUR	(158.236)	08.06.2023	(19.040)	(0,11)
Euro-Bund Future	Verkäufe	(14)	EUR	(1.328.054)	08.06.2023	(71.890)	(0,39)
Euro-OAT Future	Verkäufe	(10)	EUR	(931.010)	08.06.2023	(46.700)	(0,26)
Euro-Schatz Future	Verkäufe	(2)	EUR	(199.092)	08.06.2023	(2.060)	(0,01)
Euro-Bobl Future	Verkäufe	(24)	EUR	(2.378.088)	08.06.2023	(65.770)	(0,37)
Japan 10-Year Bond	Verkäufe	(2)	JPY	(1.369.239)	13.06.2023	(41.080)	(0,23)
10-Year US Treasury Note	Käufe	2	USD	186.962	21.06.2023	5.738	0,03
Ultra US Treasury Bond Future	Verkäufe	(1)	USD	(85.614)	21.06.2023	1.409	0,01
Ultra 10-Year US Treasury Note	Verkäufe	(8)	USD	(771.780)	21.06.2023	(28.821)	(0,16)
Long Gilt Future	Verkäufe	(11)	GBP	(1.328.210)	28.06.2023	(22.798)	(0,13)
5-Year US Treasury Note	Käufe	3	USD	280.680	30.06.2023	6.127	0,03
						EUR (284.885)	(1,59)

12 OPTIONEN ZUM MARKTWERT

Zum 31. März 2023 hatte Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income die folgenden ausstehenden Optionen:

Beschreibung	Kontrahent	Ausübungspreis	Währung	Kontrakte	Fälligkeitsdatum	Engagement in der Portfolio-Basiswährung	Marktwert in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Optionen auf Futures								
Call S&P 500 Index	UBS	4.100,000	USD	(50)	14.04.2023	20.500.000*	(295.500)	(0,27)
Call DJ Euro Stoxx 50	UBS	4.250,000	EUR	(52)	21.04.2023	2.401.055*	(62.371)	(0,06)
Call FTSE 100 Index	UBS	7.625,000	GBP	(16)	21.04.2023	1.508.469*	(19.190)	(0,02)
							USD (377.061)	(0,35)

*Das Engagement in Short-Call-Positionen ist unbegrenzt.

13 POOLING

Die SICAV kann die Gesamtheit oder einen Teil des Vermögens zweier oder mehrerer Portfolios („teilnehmende Portfolios“) in Form eines Pools anlegen und verwalten. Ein solcher Vermögenspool wird durch Übertragung von Barmitteln oder anderen Vermögenswerten der jeweiligen teilnehmenden Portfolios gebildet (wobei diese Vermögenswerte im Hinblick auf die Anlagepolitik des betreffenden Pools geeignet sein müssen).

Der Anteil eines teilnehmenden Portfolios an einem Vermögenspool wird anhand von rechnerischen Anteilen (Units) gleichen Werts an dem Vermögenspool bestimmt.

Zum 31. März 2023 verfügte die SICAV über kein Pooling von Vermögenswerten, jedoch ist das Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return Portfolio zu Anlageverwaltungszwecken nach Anlageklassen in mehrere Körbe aufgeteilt, die ausschließlich von ihm selbst gehalten werden.

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

14 ÄNDERUNGEN BEI DEN PORTFOLIOAUFGESTELLUNGEN

Änderungen bei den Portfolioaufstellungen werden den Anteilhabern auf Anfrage am eingetragenen Firmensitz der SICAV kostenlos zur Verfügung gestellt.

15 VERWÄSSERUNGSANPASSUNG

Die Portfolios können aufgrund von Handelsspreads, Transaktionskosten und Steueraufwendungen von einer Verringerung des Nettoinventarwerts je Anteil betroffen sein. Dieser entsteht, wenn der Unterberater Käufe und Verkäufe von zugrunde liegenden Anlagen vornimmt, um Mittelzu- und Abflüsse zu ermöglichen – dies ist als „Verwässerung“ bekannt. Eine Verwässerungsanpassung kann vorgenommen werden, um die Anteilhaber des Portfolios zu schützen, indem den Auswirkungen einer Verwässerung entgegengewirkt wird (die „Verwässerungsanpassung“). Wenn die Nettokapitalaktivitäten (einschließlich Zeichnungen, Rückgaben und Umtausch in ein bestimmtes Portfolio) an einem bestimmten Bewertungstag die von der Verwaltungsgesellschaft gegebenenfalls für dieses Portfolio festgelegte Schwelle übersteigen, kann der Nettoinventarwert des Portfolios nach oben oder nach unten angepasst werden, um den Nettozuflüssen bzw. den Nettoabflüssen Rechnung zu tragen.

Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilklasse im Portfolio wird separat berechnet, aber jede Verwässerungsanpassung wirkt sich identisch auf den Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilklasse des Portfolios aus. Die Höhe der Verwässerungsanpassung wird von der Verwaltungsgesellschaft festgelegt, um die geschätzten Handelsspreads, Transaktionskosten und Steueraufwendungen, die möglicherweise für das Portfolio anfallen, zu berücksichtigen. Diese Kosten können je nach Marktbedingungen und Portfoliozusammensetzung schwanken. Die Verwässerungsanpassung kann daher gegebenenfalls geändert werden. Die Verwässerungsanpassung variiert zwischen einzelnen Portfolios und je nach täglichen Nettozuflüssen und -abflüssen, beträgt jedoch maximal 2 % des ursprünglichen Nettoinventarwerts je Anteil. Die Angemessenheit der Verwässerungsanpassungen wird regelmäßig überprüft. Im normalen Geschäftsverlauf wird die Anwendung der Verwässerungsanpassung konsequent mechanisch ausgelöst. Die Verwaltungsgesellschaft behält sich jedoch das Recht vor, in ihrem eigenen Ermessen eine Verwässerungsanpassung vorzunehmen, wenn sie der Ansicht ist, dass dies im besten Interesse der bestehenden Anteilhaber ist, wie z. B. unter anderem im Falle außergewöhnlicher Umstände. Bei solchen außergewöhnlichen Umständen kann es sich unter anderem um Phasen mit einer erhöhten Marktvolatilität und Phasen mit einer reduzierten Marktliquidität handeln.

Die Verwässerungsanpassung kann auf sämtliche Portfolios mit Ausnahme des Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolios angewendet werden.

Schätzungen zur Höhe der Verwässerungsanpassung auf der Grundlage der in jedem Portfolio gehaltenen Wertpapiere sowie der Marktbedingungen zum Datum des Verkaufsprospekts (Januar 2023) werden auf der Website www.columbiathreadneedle.com veröffentlicht.

Zum 31. März 2023 wurde folgende Verwässerungsanpassung vorgenommen:

Portfolio	NIW vor Verwässerung	Verwässerungsanpassung	NIW nach Verwässerung
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	19.637.404	(7.855)	19.629.549
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	431.287.517	(2.673.983)	428.613.534

16 TRANSAKTIONS-KOSTEN

Für das Berichtsjahr entstanden der SICAV wie folgt Transaktionskosten bezüglich des Kaufs oder Verkaufs von übertragbaren Wertpapieren oder Geldmarktinstrumenten:

Portfolios	Währung	Transaktionskosten
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond ¹	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond ¹	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond ¹	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - European Social Bond ¹	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond ¹	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	EUR	3.807
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	USD	20.544
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	USD	60.526
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	USD	7.762
Threadneedle (Lux) - Global Focus	USD	2.545.294
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	USD	694.259
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	USD	92.787
Threadneedle (Lux) - Global Select	USD	442.969
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	EUR	1.170.113
Threadneedle (Lux) - American	USD	274.225

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

16 TRANSAKTIONSKOSTEN

(Fortsetzung)

Portfolios	Währung	Transaktionskosten
Threadneedle (Lux) - American Select	USD	94.992
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	USD	251.532
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	USD	160.090
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	USD	279.173
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	USD	92.563
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	USD	21.104
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	EUR	1.063.670
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	EUR	140.826
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	EUR	190.056
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	408.921
Threadneedle (Lux) - European Select	EUR	803.151
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	EUR	440.474
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	USD	82.870
Threadneedle (Lux) - Global Technology	USD	125.990
Threadneedle (Lux) - UK Equities	GBP	504.823
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	GBP	308.630
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity ²	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	USD	23.713
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities ¹	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities ¹	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	EUR	322.208
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	USD	43.830
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	USD	76.183
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	USD	2.726

Die Transaktionskosten sind in den Gesamtkosten der Anlage gemäß den Portfolioaufstellungen enthalten. Der Betrag der während des Berichtsjahres von der SICAV getragenen Transaktionskosten ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens unter der Überschrift „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapierverkäufen“ und „Nettoveränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren“ enthalten.

¹Bei festverzinslichen Wertpapieren sind die Transaktionskosten nicht vom Kaufpreis des Wertpapiers getrennt ermittelbar und können daher nicht getrennt ausgewiesen werden.

²Siehe Erläuterung 1.

17 INFORMATIONEN ZU SICHERHEITEN

In der nachstehenden Tabelle sind die von den Portfolios erhaltenen und gezahlten Barsicherheitsalden zum 31. März 2023 dargestellt:

Portfolios	Kontrahent	Anlageart	Währung	Barsicherheiten
Vom Portfolio erhaltene Sicherheiten				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Goldman Sachs	Termingeschäfte und Swaps	USD	10.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPMorgan	Termingeschäfte und Swaps	USD	12.930.000
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	JPM Securities	Termingeschäfte und Swaps	EUR	70.000
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	NatWest Markets	Termingeschäfte	EUR	60.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	JPMorgan	Termingeschäfte	EUR	210.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	HSBC	Termingeschäfte	EUR	340.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Citigroup Global Markets	Termingeschäfte und Swaps	EUR	10.000
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	JPMorgan	Termingeschäfte	USD	430.000
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	JPMorgan	Termingeschäfte	USD	410.000
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	JPMorgan	Termingeschäfte	USD	550.000
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	JPMorgan	Termingeschäfte	USD	270.000
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	JPMorgan	Termingeschäfte	USD	160.000
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Lloyds	Termingeschäfte	USD	20.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPMorgan	Termingeschäfte und Swaps	USD	900.000

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

17 INFORMATIONEN ZU SICHERHEITEN

(Fortsetzung)

Portfolios	Kontrahent	Anlageart	Währung	Barsicherheiten
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPM Securities	Termingeschäfte und Swaps	USD	230.000
Threadneedle (Lux) - Global Focus	JPMorgan	Termingeschäfte	USD	2.600.000
Threadneedle (Lux) - American	JPMorgan	Termingeschäfte	USD	2.800.000
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	JPMorgan	Termingeschäfte	USD	960.000
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	JPMorgan	Termingeschäfte	USD	1.050.000
Threadneedle (Lux) - Global Technology	JPMorgan	Termingeschäfte	USD	610.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	JPMorgan	Termingeschäfte	USD	210.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Citigroup Global Markets	Termingeschäfte und Swaps	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Goldman Sachs	Termingeschäfte und Swaps	EUR	410.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	JPM Securities	Termingeschäfte und Swaps	EUR	1.230.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Goldman Sachs	Swaps	EUR	120.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	UBS	Swaps	EUR	530.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	USD	50.000
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	UBS	Swaps	USD	830.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Goldman Sachs	Swaps	USD	1.920.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	JPMorgan	Termingeschäfte und Swaps	USD	2.750.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Macquarie	Swaps	USD	1.070.000
Vom Portfolio gezahlte Sicherheiten				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Securities	Termingeschäfte und Swaps	USD	7.640.000
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	JPM Securities	Termingeschäfte	EUR	260.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	JPM Securities	Termingeschäfte	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	JPMorgan	Termingeschäfte	EUR	330.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Goldman Sachs	Swaps	EUR	110.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	HSBC	Termingeschäfte	EUR	250.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Lloyds	Termingeschäfte	USD	840.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	JPMorgan	Termingeschäfte	EUR	540.000
Threadneedle (Lux) - European Select	JPMorgan	Termingeschäfte	EUR	370.000
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	JPMorgan	Termingeschäfte	EUR	150.000
Threadneedle (Lux) - UK Equities	JPMorgan	Termingeschäfte	GBP	20.000
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	JPMorgan	Termingeschäfte	GBP	110.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	UBS	Swaps	USD	170.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Barclays	Termingeschäfte und Swaps	EUR	670.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	BNP Paribas	Swaps	EUR	660.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	JPM Securities	Termingeschäfte und Swaps	EUR	20.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	UBS	Swaps	USD	450.000

18 ÜBERKREUZBETEILIGUNGEN IN PORTFOLIOS

Zum 31. März 2023 investierte das Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return Portfolio in Anteile folgender Portfolios:

Cross Investment Portfolio	Währung	Marktwert	% des Nettovermögens in der Basiswährung des Cross Investment Portfolio
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio	EUR	25.696	0,01
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	EUR	32.524	0,04
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	EUR	2.395	0,00
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	EUR	38.923	0,06
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	EUR	4.730	0,01
Threadneedle (Lux) - Global Focus	EUR	55.027	0,00
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	EUR	32.503	0,18
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	8.712	0,00

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

18 ÜBERKREUZBETEILIGUNGEN IN PORTFOLIOS

(Fortsetzung)

Zum 31. März 2023 investierte das Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return Portfolio in Anteile folgender Portfolios:

Cross Investment Portfolio	Währung	Marktwert	% des Nettovermögens in der Basiswährung des Cross Investment Portfolio
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio	USD	1.885.062	0,95

Die Auswirkungen der Transaktionen im Rahmen von Überkreuzbeteiligungen wurden aus der aggregierten Aufstellung des Nettovermögens und der Aufstellung der Entwicklung des Nettovermögens entfernt.

Bitte lesen Sie auch Erläuterung 2 xi) zur Rückvergütung von Anlageverwaltungsgebühren.

19 TERMINEINLAGEN

Die folgende Tabelle zeigt die von der SICAV zum 31. März 2023 gehaltenen Termineinlagen:

Portfolios	Kontrahent	Währung	Betrag der Termineinlagen (in der Basiswährung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	Sumitomo Bank Ltd London	USD	1.817.561
	Mitsubishi UFJ Securities	USD	1.829.249
	Gesamt	USD	3.646.810
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Rabobank Nederland	USD	642.605
	Mitsubishi UFJ Securities	USD	768.696
	Gesamt	USD	1.411.301
Threadneedle (Lux) - American Select	Mitsubishi UFJ Securities	USD	5.001.325
	Gesamt	USD	5.001.325
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Mitsubishi UFJ Securities	USD	2.337.322
	ANZ Banking Group Ltd	USD	2.577.998
	Gesamt	USD	4.915.320

20 SONSTIGE VERMÖGENSWERTE

Die sonstigen Vermögenswerte können Anpassungen des beizulegenden Zeitwerts umfassen, die vorgenommen wurden, als bestimmte Märkte zum Jahresende geschlossen waren, um Market Timing zu verhindern, auf der Grundlage des bestehenden Preisbestimmungsverfahrens auf der Fondsebene.

Die sonstigen Vermögenswerte können auch Quellensteuer und/oder ausländische Steuern umfassen.

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

Die Gesamtkostenquote wird gemäß der Richtlinie der Asset Management Association Switzerland (AMAS) ermittelt.

Die verwendete Formel lautet wie folgt:

Die TER erfasst sämtliche den Anteilklassen fortlaufend belasteten Provisionen und Kosten (Betriebskosten) rückwirkend als prozentualen Anteil des Nettovermögens der Anteilklassen und wird anhand der folgenden Formel berechnet:

$$\text{TER \%} = \frac{\text{Gesamtbetriebskosten}}{\text{Durchschnittliches Nettovermögen}} \times 100$$

Wenn ein Fonds mehr als 10 % in andere Organismen für gemeinsame Anlagen (Zielfonds) investiert, umfasst die Berechnung den Anteil des Fonds an den Aufwendungen der Zielfonds abzüglich erhaltener Gebührennachlässe.

Die Gesamtkostenquote für das Berichtsjahr bis zum 31. März 2023 beträgt:

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	AEC	0,80 %	
	AEH	0,80 %	
	AKH	0,71 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ANH	0,73 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AU	0,80 %	
	AUP	0,80 %	
	DEC	1,55 %	
	DEH	1,55 %	
	DU	1,55 %	
	DUP	1,55 %	
	IEC	0,50 %	
	IEH	0,55 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IEP	0,50 %	
	IGC	0,58 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IGH	0,56 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IKH	0,56 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	INH	0,50 %	
	IU	0,60 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IUP	0,57 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	NEC	0,40 %	
NEH	0,40 %		
NGC	0,40 %		
NGH	0,40 %		
NU	0,40 %		
NUP	0,40 %		
XEH	0,10 %		
XFH	0,10 %		
XGH	0,10 %		
XU	0,10 %		
ZEH	0,55 %		
ZFH	0,55 %		

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond (Fortsetzung)	ZGH	0,55 %	
	ZU	0,55 %	
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	AE	0,93 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ANH	0,87 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IE	0,55 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IEP	0,50 %	
	INH	0,50 %	
	XE	0,10 %	
	XFH	0,10 %	
	XGH	0,10 %	
	XUH	0,10 %	
	ZE	0,55 %	
	ZFH	0,62 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	1E	1,19 %	
	1G	1,19 %	
	2E	0,58 %	
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	2G	0,51 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	3G	0,69 %	
	4E	0,08 %	
	4G	0,08 %	
	8E	0,62 %	
	8G	0,62 %	
	9G	0,60 %	
	AE	1,50 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AKH	1,39 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ANH	1,45 %	
IE	0,71 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
IEP	0,71 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
IKH	0,65 %		
INH	0,65 %		
XE	0,10 %		
ZE	0,80 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
ZEP	0,85 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
1E	1,38 %		
1EP	1,38 %		
1G	1,38 %		
1GP	1,38 %		
1UT	1,38 %		

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond (Fortsetzung)	2E	0,82 %	
	2EP	0,82 %	
	2FH	0,82 %	
	2G	0,82 %	
	2GP	0,74 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	3E	0,77 %	
	3EP	0,77 %	
	3FC	0,77 %	
	3FH	0,77 %	
	3G	0,77 %	
	3GP	0,77 %	
	4E	0,07 %	
	4G	0,07 %	
	8E	0,86 %	
	8EP	0,86 %	
	8FH	0,86 %	
	8G	0,86 %	
	8GP	0,86 %	
	9E	0,70 %	
	9EP	0,70 %	
	9FC	0,59 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	9FH	0,70 %	
	9G	0,62 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	9GP	0,62 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	AE	0,90 %	
	AEP	0,90 %	
	AKH	0,90 %	
	ANH	0,90 %	
	IE	0,50 %	
	IEP	0,50 %	
	IGC	0,50 %	
	IGH	0,50 %	
	IKH	0,50 %	
	INH	0,50 %	
	XE	0,10 %	
	XGC	0,10 %	
	XGH	0,10 %	
	ZE	0,55 %	
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	AE	0,55 %	
	AEP	0,55 %	
	AFH	0,55 %	
	AKH	0,55 %	
	ANH	0,55 %	
	ASC	0,60 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ASH	0,55 %	
	AUC	0,55 %	

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - European Social Bond (Fortsetzung)	AUH	0,50 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ID	0,40 %	
	IE	0,40 %	
	IEP	0,40 %	
	IFH	0,40 %	
	IGH	0,46 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IKH	0,51 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	INH	0,49 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ISC	0,27 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ISH	0,40 %	
	IUC	0,40 %	
	IUH	0,40 %	
	LE	0,40 %	
	NEP	0,40 %	
	ZD	0,45 %	
	ZE	0,45 %	
	ZEP	0,45 %	
	ZFH	0,45 %	
	ZGC	0,45 %	
	ZGH	0,45 %	
ZUH	0,45 %		
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	AE	1,10 %	
	AEP	1,10 %	
	AKH	1,10 %	
	ANH	1,10 %	
	AUH	1,10 %	
	DE	1,65 %	
	DEP	1,65 %	
	DUH	1,65 %	
	IE	0,50 %	
	INH	0,50 %	
ZE	0,62 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	AEC	1,55 %	
	AEH	1,55 %	
	AKH	1,61 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ANH	1,55 %	
	ASH	1,55 %	
	AU	1,60 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AUP	1,55 %	
	DEC	1,65 %	
	DEH	1,65 %	
	DU	1,65 %	
IEC	0,75 %		

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds (Fortsetzung)	IEH	0,75 %	
	IU	0,75 %	
	W	1,20 %	
	WEH	1,20 %	
	ZU	0,65 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	XUP	0,10 %	
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	AEC	1,55 %	
	AEH	1,55 %	
	AKH	1,50 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ANH	1,55 %	
	ASH	1,55 %	
	AU	1,55 %	
	AUP	1,55 %	
	DEH	1,65 %	
	DU	1,65 %	
	IEH	0,75 %	
	IU	0,67 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	SU	1,70 %	
	SUP	1,75 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	W	1,20 %	
	XUP	0,10 %	
	ZU	0,68 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	AEC	1,50 %	
	AEH	1,50 %	
	AKH	1,50 %	
	ANH	1,50 %	
	ASC	1,50 %	
	ASH	1,50 %	
	AU	1,56 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AUP	1,50 %	
	DEH	1,65 %	
	DU	1,65 %	
	IE	0,75 %	
	IEH	0,75 %	
	XU	0,10 %	
	XUP	0,10 %	
	ZEH	0,80 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	0,66 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	AEC	1,50 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AEH	1,45 %	
	AKH	1,45 %	

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond (Fortsetzung)	ANH	1,45 %	
	ASH	1,51 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AU	1,45 %	
	AUP	1,45 %	
	DEC	1,71 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DEH	1,70 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DU	1,65 %	
	IEC	0,58 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IEH	0,65 %	
	IKH	0,57 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	INH	0,57 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ISC	0,65 %	
	IU	0,65 %	
	TEH	0,65 %	
	XUP	0,10 %	
	ZFH	0,69 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZGH	0,70 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	0,75 %	
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	AEH	1,10 %	
	AKH	1,10 %	
	AS	1,10 %	
	ASC	1,10 %	
	ASH	1,10 %	
	AU	1,10 %	
	AUP	1,10 %	
	AVC	0,93 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AVH	1,10 %	
	DEH	1,40 %	
	IEH	0,50 %	
	IGH	0,50 %	
	ISH	0,50 %	
	IU	0,50 %	
	XU	0,10 %	
	ZU	0,55 %	
	ZUP	0,55 %	
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	AE	1,63 %	Die derzeitige Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entsprechen.
	DE	2,38 %	Die derzeitige Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entsprechen.

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	AEC	1,65 %	
	AEH	1,65 %	
	AKH	1,80 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AU	1,65 %	
	AUP	1,65 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IEH	0,95 %	
	IGH	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	W	1,75 %	
	ZU	1,14 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	AE	1,55 %	
	AEC	1,55 %	
	AEH	1,55 %	
	AEP	1,55 %	
	AS	1,72 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ASC	1,55 %	
	ASH	1,55 %	
	ASP	1,55 %	
	AU	1,55 %	
	AUM	1,55 %	
	AUP	1,55 %	
	DEC	2,30 %	
	DEH	2,30 %	
	DEP	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	DUP	2,30 %	
	ZE	1,12 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZEC	1,22 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZEH	1,05 %	
	ZFH	1,16 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
ZU	1,05 %		
ZUP	1,18 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	AE	1,79 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AEC	1,65 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AEH	1,75 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AU	1,75 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AUP	1,64 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IE	0,75 %	
	IEH	0,70 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities (Fortsetzung)	IG	0,75 %	
	IU	0,68 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	LE	0,45 %	
	LG	0,40 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	XU	0,10 %	
	ZE	0,90 %	
	ZEC	0,97 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZEH	0,97 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	0,95 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZUP	0,98 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
Threadneedle (Lux) - Global Focus	AEH	1,70 %	
	AEP	1,70 %	
	ASH	1,64 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AU	1,70 %	
	AUP	1,70 %	
	DEH	2,45 %	
	DU	2,45 %	
	IE	0,85 %	
	IEH	0,85 %	
	IU	0,85 %	
	IUP	0,85 %	
	W	1,72 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	XU	0,10 %	
	ZE	0,95 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZEH	0,90 %	
	ZEP	0,95 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZFH	1,09 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZG	0,95 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	0,98 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	AEH	1,70 %	
	AU	1,70 %	
	DEH	2,50 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DU	2,50 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IE	0,85 %	
	IEH	0,85 %	

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities (Fortsetzung)	IU	0,90 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	XU	0,10 %	
	ZU	0,95 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	1E	1,71 %	
	1U	1,71 %	
	2E	1,10 %	
	2U	1,10 %	
	8E	1,23 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	8U	1,14 %	
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	AEC	1,80 %
AUP		1,90 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
DEC		2,39 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
DUP		2,30 %	
IU		0,95 %	
TE		0,98 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
ZU		1,12 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
1E		1,68 %	
1EP		1,68 %	
1SC		1,68 %	
1SH		1,68 %	
1ST		1,68 %	
1U		1,68 %	
1UP		1,68 %	
1VT		1,68 %	
2E		1,07 %	
2EP		1,07 %	
2U		1,07 %	
2UP		1,02 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
3E		0,93 %	
3EP		0,93 %	
3U		0,93 %	
3UP		0,93 %	
8E		1,11 %	
8EP		1,11 %	
8U		1,11 %	
8UP		1,11 %	
9E		0,95 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
9EP		0,89 %	
9U		0,84 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
9UP	0,89 %		
Threadneedle (Lux) - Global Select	IU	0,85 %	
	ZU	0,95 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Global Select (Fortsetzung)	1E	1,68 %	
	1U	1,68 %	
	2E	1,07 %	
	2U	1,07 %	
	3U	0,90 %	
	8E	1,11 %	
	8U	1,11 %	
	9U	0,85 %	
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	AE	1,80 %
AEP		1,80 %	
AK		1,80 %	
AUP		1,80 %	
DE		2,30 %	
IE		0,95 %	
IEP		0,95 %	
NE		0,75 %	
XE		0,15 %	
XFH		0,07 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
XG		0,08 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
XGH		0,08 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
XU		0,15 %	
ZE		1,05 %	
ZFH		1,05 %	
ZG		1,05 %	
ZGH		1,05 %	
ZU	1,05 %		
Threadneedle (Lux) - American	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,15 %	
	DU	2,15 %	
	IEH	0,90 %	
	IU	0,90 %	
	W	1,50 %	
	ZE	1,00 %	
	ZEH	1,00 %	
	ZU	1,12 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	1E	1,67 %	
	1EH	1,67 %	
	1EP	1,67 %	
	1U	1,67 %	
	2E	1,06 %	
	2U	1,06 %	
	3EH	0,88 %	
	3U	0,88 %	
	8E	1,10 %	
	8U	1,10 %	
9EH	0,84 %		
9U	0,84 %		

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - American Select	AD	1,85 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AEH	1,80 %	
	AN	1,85 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AU	1,80 %	
	DEH	2,55 %	
	DU	2,55 %	
	ID	0,93 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IE	0,93 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IEH	1,00 %	
	IN	0,93 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	W	1,75 %	
	ZEH	1,17 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	1,10 %	
	1E	1,67 %	
	1EH	1,67 %	
	1EP	1,67 %	
	1U	1,67 %	
	2EH	1,06 %	
	2U	1,06 %	
	3E	0,87 %	
3U	0,87 %		
8EH	1,10 %		
8U	1,10 %		
9E	0,83 %		
9U	0,83 %		
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	AEH	1,80 %	
	ASH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IE	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,68 %	
	1EP	1,68 %	
	1U	1,68 %	
	2U	1,07 %	
	3EH	0,93 %	
	3U	0,93 %	
8U	1,11 %		
9EH	0,84 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
9U	0,89 %		
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	AE	1,80 %	
	AF	1,91 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AS	1,80 %	

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity (Fortsetzung)	ASH	1,80 %	
	AU	1,91 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DE	2,55 %	
	IF	0,80 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ISH	0,78 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IU	0,95 %	
	XU	0,15 %	
	XUP	0,15 %	
	ZE	1,11 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZEH	1,05 %	
	ZF	1,12 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZG	1,11 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	1,05 %	
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	AE	1,94 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AEH	1,71 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DE	2,44 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DEH	2,22 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IE	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,70 %	
	1U	1,70 %	
	2E	1,09 %	
	2U	1,09 %	
	3U	0,95 %	
	8E	1,13 %	
	8U	1,13 %	
	9U	0,91 %	
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	AEC	1,92 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AEH	1,85 %	
	AU	1,85 %	
	AUP	1,85 %	
	DU	2,35 %	
	IU	1,05 %	
	XS	0,07 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	XSH	0,15 %	
	ZEH	1,10 %	
	ZFH	1,18 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZGH	1,22 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	1,10 %	

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	AE	0,70 %	
	AEH	0,57 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AU	0,57 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AUP	0,55 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DE	0,90 %	
	DEH	0,90 %	
	DU	0,90 %	
	IE	0,35 %	
	IEC	0,35 %	
	IEH	0,40 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IFH	0,40 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IG	0,35 %	
	IU	0,35 %	
	NE	0,20 %	
	NG	0,20 %	
	NU	0,20 %	
	XG	0,10 %	
	ZEH	0,45 %	
	ZFH	0,45 %	
	ZU	0,45 %	
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	AE	1,50 %	
	ASH	1,50 %	
	AUH	1,50 %	
	DE	1,70 %	
	IE	0,75 %	
	W	1,65 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	XE	0,10 %	
	ZE	0,90 %	
	ZUH	0,90 %	
	1E	1,53 %	
	1EP	1,53 %	
	1G	1,53 %	
	1GP	1,53 %	
	2E	1,08 %	
	2G	1,08 %	
	2U	1,00 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	3E	0,94 %	
	3G	0,94 %	
	3GP	0,94 %	
	4E	0,08 %	
	4G	0,08 %	
	8E	1,12 %	
	8G	1,12 %	
	8U	1,03 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	9E	0,85 %	

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities (Fortsetzung)	9G	0,85 %	
	9GP	0,85 %	
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	AE	1,80 %	
	AUP	1,92 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DE	2,15 %	
	DEP	2,15 %	
	IE	0,65 %	
	IEP	0,65 %	
	ZE	1,12 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZEP	1,05 %	
	1E	1,70 %	
	1EP	1,70 %	
	1G	1,70 %	
	1GP	1,70 %	
	2E	1,09 %	
	2EP	1,09 %	
	2G	1,02 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	2GP	1,09 %	
	3EP	0,95 %	
	3G	0,95 %	
	3GP	0,95 %	
	4GP	0,09 %	
8E	1,13 %		
8EP	1,13 %		
8G	1,13 %		
8GP	1,13 %		
9EP	0,91 %		
9G	0,91 %		
9GP	0,86 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	AE	1,85 %	
	ASH	1,85 %	
	AUH	1,85 %	
	DE	2,75 %	
	DUH	2,80 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IE	1,10 %	
	W	1,90 %	
	XE	0,07 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZE	1,10 %	
	ZFH	1,10 %	
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	IE	0,95 %	
	ZE	1,10 %	
	1E	1,72 %	
	1EP	1,72 %	

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies (Fortsetzung)	1FH	1,72 %	
	1G	1,72 %	
	1UH	1,72 %	
	2E	1,07 %	
	2G	1,07 %	
	3E	0,91 %	
	3EP	0,91 %	
	3FH	0,91 %	
	3G	0,91 %	
	3GP	0,91 %	
	3UH	0,91 %	
	4E	0,07 %	
	4G	0,07 %	
	8E	1,11 %	
	8G	1,11 %	
	9E	0,87 %	
	9EP	0,74 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	9FH	0,87 %	
	9G	0,87 %	
	9GP	0,75 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	9UH	0,87 %	
Threadneedle (Lux) - European Select	AE	1,80 %	
	AGH	1,75 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AUH	1,75 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DUH	2,41 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IE	0,95 %	
	ZE	1,17 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZG	1,05 %	
	ZGH	1,05 %	
	1E	1,65 %	
	1EP	1,65 %	
	1SH	1,65 %	
	1U	1,65 %	
	1UH	1,65 %	
	2E	1,06 %	
	2EP	1,06 %	
	3E	0,88 %	
	3U	0,88 %	
	8E	1,10 %	
	8EP	1,10 %	
	9E	0,84 %	
	9U	0,84 %	
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	IE	0,95 %	
	ZE	1,10 %	
	1E	1,72 %	

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies (Fortsetzung)	1EP	1,72 %	
	1FH	1,57 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	2E	1,07 %	
	3E	0,93 %	
	3EP	0,93 %	
	3FH	0,93 %	
	8E	1,11 %	
	9E	0,89 %	
	9EP	0,89 %	
	9FH	0,89 %	
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	AUP	1,80 %	
	DEH	2,55 %	
	DU	2,55 %	
	DUP	2,55 %	
	IEP	0,95 %	
	IU	0,89 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	W	2,00 %	
	XU	0,15 %	
	XUP	0,15 %	
	ZG	1,18 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZGH	1,05 %	
	ZGP	1,21 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	1,16 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZUP	1,05 %	
Threadneedle (Lux) - Global Technology	AEH	1,95 %	
	AS	1,95 %	
	AU	1,95 %	
	AUP	1,95 %	
	BU	2,35 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IE	1,05 %	
	IEH	1,05 %	
	IG	1,05 %	
	IU	1,05 %	
	ZEH	1,15 %	
	ZFH	1,15 %	
	ZG	1,15 %	
	ZU	1,15 %	
Threadneedle (Lux) - UK Equities	AE	1,80 %	
	AEH	1,80 %	
	AFH	1,80 %	
	AG	1,80 %	
	AGP	1,80 %	
	DEH	2,60 %	

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - UK Equities (Fortsetzung)	DG	2,40 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IE	0,85 %	
	IEH	0,85 %	
	IG	0,85 %	
	IGP	0,85 %	
	NEH	0,57 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	NFH	0,58 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	NG	0,68 %	
	NGP	0,57 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	NUH	0,58 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	TEH	0,62 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	TFH	0,61 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	TG	0,63 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	TGP	0,64 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	TUH	0,59 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZE	1,05 %	
	ZEH	1,05 %	
	ZFH	1,05 %	
	ZG	1,05 %	
	ZGP	1,05 %	
	ZUH	1,05 %	
	3EH	0,87 %	
	3FH	0,87 %	
3UH	0,87 %		
9EH	0,83 %		
9EP	0,83 %		
9FH	0,83 %		
9G	0,83 %		
9UH	0,89 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	AE	1,80 %	
	AEC	1,80 %	
	AEH	1,80 %	
	AG	1,80 %	
	ASC	1,80 %	
	AUC	1,80 %	
	DE	2,55 %	
	DEC	2,55 %	
	DEH	2,55 %	
	DG	2,61 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
DGP	2,47 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
IE	0,85 %		

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income (Fortsetzung)	IEH	0,85 %	
	IG	0,85 %	
	IGP	0,85 %	
	IU	0,85 %	
	IUH	0,85 %	
	LG	0,70 %	
	LGP	0,70 %	
	ZE	1,05 %	
	ZEH	1,05 %	
	ZFH	1,05 %	
	ZG	1,05 %	
	ZGP	1,05 %	
	ZUH	1,05 %	
	1EH	1,64 %	
	1FH	1,64 %	
	1UH	1,64 %	
	3EH	0,88 %	
	3FH	0,88 %	
	3UH	0,88 %	
	9EH	0,84 %	
	9FH	0,84 %	
	9G	0,84 %	
	9UH	0,84 %	
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	AEH	1,80 %	
	AFH	1,80 %	
	AGH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IEH	0,95 %	
	IGH	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	XGH	0,15 %	
	ZE	1,10 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZEH	1,21 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZGH	1,05 %	
	ZU	1,05 %	
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	AE	1,12 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IE	0,51 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZE	0,70 %	
	1E	1,17 %	
	1EP	1,17 %	
	1GH	1,17 %	
	1UH	1,17 %	
	2E	0,56 %	
	2EP	0,56 %	
	2GC	0,47 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities (Fortsetzung)	2GH	0,56 %	
	4GH	0,06 %	
	8E	0,60 %	
	8EP	0,60 %	
	8GC	0,60 %	
	8GH	0,60 %	
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	AE	1,10 %	
	AFH	1,05 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AKH	1,10 %	
	ANH	1,10 %	
	AUH	1,10 %	
	DE	1,65 %	
	IE	0,45 %	
	IEP	0,45 %	
	IGH	0,45 %	
	INH	0,45 %	
	IU	0,45 %	
	IUH	0,51 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	JE	0,45 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	JGH	0,44 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	JUH	0,46 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	LE	0,30 %	
	LEP	0,15 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	LGH	0,15 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	XE	0,10 %	
	XGH	0,10 %	
	XUH	0,10 %	
	YE	0,56 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	YGH	0,50 %	
	YUH	0,50 %	
	ZE	0,60 %	
	ZFH	0,60 %	
	ZGH	0,60 %	
	ZUH	0,60 %	
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	AE	1,85 %	
	AEP	1,85 %	

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha (Fortsetzung)	AUH	1,96 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DE	2,35 %	
	IE	0,95 %	
	IGH	0,95 %	
	LE	0,575 %	
	XGH	0,15 %	
	ZE	1,05 %	
	ZF	1,18 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZFH	1,11 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZGH	1,17 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IU	0,90 %	
	ZU	1,16 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	1E	1,69 %	
	1EH	1,69 %	
	1U	1,69 %	
	2E	0,83 %	
	2U	0,83 %	
	3U	0,94 %	
	8E	0,87 %	
8U	0,87 %		
9U	0,90 %		
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	AEH	1,85 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AU	1,80 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IU	0,90 %	
	ZU	1,22 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	1E	1,69 %	
	1U	1,69 %	
	2E	0,88 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	2U	0,83 %	
	8E	0,87 %	
	8U	0,87 %	
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	AEH	1,20 %
AFH		1,20 %	
AGH		1,20 %	
ASH		1,26 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
AU		1,25 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.

Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER	Kommentare
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities (Fortsetzung)	DEH	1,45 %	
	DU	1,45 %	
	IEH	0,90 %	
	IG	0,90 %	
	IGH	0,90 %	
	IU	0,97 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	NG	0,55 %	
	XU	0,10 %	
	ZEH	0,95 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZFH	0,90 %	
	ZGH	0,97 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	1,01 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. August 2022 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.

22 EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG

Mit Wirkung zum 28. April 2023 wurde für das Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return Portfolio ein Liquidationsverfahren eingeleitet.

Mit Wirkung zum 13. Juli 2023 wurde für das Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities Portfolio und das Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolio ein Liquidationsverfahren eingeleitet.

23 SONSTIGE INFORMATIONEN

Die groß angelegte Invasion der Ukraine durch Russland im Februar 2022 hat Sanktionen und Marktstörungen nach sich gezogen, darunter Kursrückgänge an den regionalen und globalen Aktienmärkten, außergewöhnliche Volatilität an den globalen Rohstoffmärkten sowie eine erhebliche Abwertung der russischen Währung. Das Ausmaß und die Dauer der Militäraktion lassen sich nicht vorhersagen, könnten jedoch erheblich sein. Die durch die russische Militäraktion verursachten Marktstörungen sowie etwaige Gegenmaßnahmen oder Reaktionen darauf (einschließlich internationaler Sanktionen, einer Herabstufung der Kreditwürdigkeit des Landes, Kauf- und Finanzierungsbeschränkungen, Boykotte, Zölle, Änderungen der Verbraucher- oder Käuferpräferenzen, Cyberangriffe und Spionage) könnten schwerwiegende nachteilige Auswirkungen auf die regionalen und/oder globalen Wertpapier- und Rohstoffmärkte haben, unter anderem auch auf die Märkte für Erdöl und Erdgas. Zu diesen Auswirkungen können eine reduzierte Marktliquidität, Krisen an den Kreditmärkten, weitere Unterbrechungen der globalen Lieferketten, ein erhöhtes Inflationsrisiko und ein eingeschränkter Zugang zu Anlagen in bestimmten internationalen Märkten und/oder Emittenten gehören. Diese Entwicklungen und weitere damit zusammenhängende Ereignisse könnten sich negativ auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirken.

Die regelmäßigen Informationen zu Finanzprodukten gemäß Artikel 8(1) der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 der Verordnung (EU) 2020/852 sind Bestandteil des beiliegenden ungeprüften Anhangs.

Gesamtrisiko (ungeprüft)

Gesamtrisiko und Leverage

Das Gesamtrisiko des OGAW wird unter einem Commitment-Ansatz, einem absoluten Value-at-Risk-Ansatz (absoluter VaR) oder einem relativen Value-at-Risk-Ansatz (relativer VaR) verwaltet.

Die Informationen zum Gesamtmarktrisiko für das Berichtsjahr zum 31. März 2023 lauten wie folgt:

Commitment-Ansatz

Alle Portfolios, die nicht unter den VaR-Ansatz fallen, wenden zur Kontrolle und Bemessung des Gesamtrisikos den Commitment-Ansatz an.

Das Gesamtrisiko der Teilfonds wird auf Grundlage des Commitment-Ansatzes in Übereinstimmung mit der in den ESMA-Richtlinien 10-788 beschriebenen Methodik berechnet.

Für den Zeitraum von April 2022 bis März 2023:

Teilfonds, die einen VaR-Ansatz nutzen	Berechnungsmethode*	VaR-Modell*	Referenzportfolio	Interne VaR-Leitlinien (%)	Rechtliche und vertragliche VaR-Grenze (%)	Einjährig rollierend				
						Niedrigste Nutzung der VaR-Grenze	Höchste Nutzung der VaR-Grenze	Durchschnittliche Nutzung der VaR-Grenze	Durchschnittliches Commitment-Engagement	Durchschnittliche Summe der Nennwerte
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Relativer VaR	Kovarianz	Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (USD Hedged)	1,5 x Benchmark-VaR	2,0 x Benchmark-VaR	99,08 %	112,46 %	105,86 %	38,22 %	89,28 %
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	Relativer VaR	Kovarianz	ICE BofA Custom Index 0-4 Year European Currency High Yield, BB-B, 3% Constrained, Excluding Subordinated Debt (EUR Hedged)	1,5 x Benchmark-VaR	2,0 x Benchmark-VaR	86,04 %	115,77 %	98,93 %	0,46 %	25,48 %
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Relativer VaR	Kovarianz	ICE BofA 1-7 Year All Euro Government Index (20%) ICE BofA 1-10 Year Euro Corporate Index (40%) ICE BofA European Currency High Yield Constrained Index (40%)	1,8 x Benchmark-VaR	2,0 x Benchmark-VaR	80,22 %	105,17 %	95,86 %	90,06 %	128,44 %
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	Relativer VaR	Kovarianz	J.P. Morgan Asia Credit Index Diversified	1,8 x Benchmark-VaR	2,0 x Benchmark-VaR	95,43 %	133,11 %	110,60 %	6,98 %	12,35 %
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Relativer VaR	Kovarianz	MSCI ACWI Index (45%) ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained Index (USD Hedged) (30%) Bloomberg Global Aggregate Index (USD Hedged) (20%) 30-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR) (5%)	1,8 x Benchmark-VaR	2,0 x Benchmark-VaR	52,50 %	125,20 %	104,45 %	30,22 %	76,91 %
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Absoluter VaR	Kovarianz	k. A.	8	20	2,97 %	7,49 %	5,04 %	43,39 %	91,56 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Absoluter VaR	Kovarianz	k. A.	10	20	4,20 %	9,43 %	7,13 %	51,69 %	51,69 %

Gesamtrisiko (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Teilfonds, die einen VaR-Ansatz nutzen	Berechnungsmethode*	VaR-Modell*	Referenzportfolio	Interne VaR-Leitlinien (%)	Rechtliche und vertragliche VaR-Grenze (%)	Einjährig rollierend				
						Niedrigste Nutzung der VaR-Grenze	Höchste Nutzung der VaR-Grenze	Durchschnittliche Nutzung der VaR-Grenze	Durchschnittliches Commitment-Engagement	Durchschnittliche Summe der Nennwerte
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Absoluter VaR	Kovarianz	k. A.	3,3	20	1,04 %	2,87 %	1,89 %	199,06 %	333,12 %
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Absoluter VaR	Kovarianz	k. A.	4,7	20	1,07 %	2,75 %	1,96 %	157,55 %	220,73 %
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Relativer VaR	Kovarianz	MSCI ACWI Index	1,6 x Benchmark-VaR	2,0 x Benchmark-VaR	100,74 %	127,33 %	118,13 %	85,20 %	91,61 %
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Relativer VaR	Kovarianz	S&P 500 Index	1,6 x Benchmark-VaR	2,0 x Benchmark-VaR	100,44 %	123,67 %	108,58 %	48,18 %	48,54 %
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Relativer VaR	Historisch	Bloomberg Commodity Index	1,3 x Benchmark-VaR	1,3 x Benchmark-VaR	92,32 %	118,96 %	100,80 %	8,75 %	399,01 %

*Berechnungsmethode. Das VaR-Modell basiert auf einem Konfidenzintervall von 99 % bei einer einmonatigen Haltedauer. Das Kovarianz-Modell verwendet Daten aus 2 Jahren, gewichtet mit einer Halbwertszeit von 6 Monaten, und wird täglich aktualisiert. Bei der historischen Methode werden tägliche Daten aus einem Jahr verwendet.

Informationen für Anteilinhaber (ungeprüft)

Die SICAV ist eine im Großherzogtum Luxemburg entsprechend der aktuellen Fassung des Gesetzes vom 10. August 1915 gegründete Investmentgesellschaft mit variablem Kapital („*Société d'Investissement à Capital Variable*“) und gilt gemäß Teil I der aktuellen Fassung des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW).

Die SICAV wurde am 10. Februar 1995 für unbegrenzte Dauer gegründet. Die Satzung der SICAV wurde erstmalig am 31. März 1995 im *Recueil des Sociétés et Associations* des Großherzogtums Luxemburg veröffentlicht und mit Wirkung zum 14. September 2018 zuletzt geändert.

Die SICAV ist unter der Nummer R.C.S. Luxemburg B-50216 eingetragen.

Die Jahreshauptversammlung der Anteilinhaber der SICAV findet, wie in der Versammlungsmitteilung angegeben, innerhalb von sechs Monaten nach Ablauf des Rechnungsjahres in Luxemburg statt. Die Jahreshauptversammlung kann im Ausland abgehalten werden, wenn außergewöhnliche Umstände dies nach dem absoluten und endgültigen Urteil des Verwaltungsrats erfordern. Sonstige Versammlungen der Anteilinhaber können zu den Terminen und an den Orten in Luxemburg abgehalten werden, die in der Versammlungsmitteilung angegeben sind. Versammlungsmitteilungen erfolgen gemäß luxemburgischem Recht und im Einklang mit den maßgeblichen Regelungen der Länder, in denen die Anteile öffentlich angeboten werden. Die Versammlungsmitteilung muss Ort und Termin der Versammlung, die Teilnahmevoraussetzungen, die Tagesordnung, die Mindestanwesenheitsanforderungen zur Beschlussfähigkeit und die Voraussetzungen für die Stimmabgabe enthalten.

Das Rechnungsjahr der SICAV endet am 31. März eines jeden Jahres.

Der Jahresbericht und der geprüfte Abschluss sowie der ungeprüfte Halbjahresbericht sind am eingetragenen Firmensitz der SICAV und am Hauptsitz der einzelnen Zahl- und Vertriebsstellen erhältlich. Die konsolidierten Abschlüsse der SICAV werden in US-Dollar ausgedrückt.

Der Nettoinventarwert sowie die Ausgabe- und Rücknahmepreise der Anteile der SICAV werden am eingetragenen Firmensitz der SICAV veröffentlicht.

Dieser Bericht stellt kein Angebot und keine Aufforderung zum Kauf von Anteilen der SICAV dar. Zeichnungen werden nur auf der Grundlage des Verkaufsprospekts, des letzten verfügbaren Jahresberichts mit dem geprüften Jahresabschluss zum 31. März und, sofern danach veröffentlicht, des letzten verfügbaren Halbjahresberichts zum 30. September akzeptiert.

Bestimmte Portfolios und/oder Anteilklassen in diesem Bericht sind zu diesem Datum möglicherweise nicht in allen Rechtsordnungen zugelassen oder werden nicht in allen Rechtsordnungen zum Kauf angeboten.

Dokument mit den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) / Basisinformationsblatt („KID“) - Zeichnungsanforderungen

Das Dokument mit den wesentlichen Anlegerinformationen (Key Investor Information Document, KIID) bzw. das Basisinformationsblatt (Key Information Document, KID) ist ein vorvertragliches Dokument und Anleger müssen bestätigen, dass sie das neueste KIID/KID gelesen haben, bevor sie eine Zeichnung tätigen. Die Verwaltungsgesellschaft darf einen Zeichnungsantrag ablehnen, wenn ein Anleger bei Antragstellung nicht bestätigt, dass er das neueste KIID/KID zur Kenntnis genommen hat. Das neueste KIID/KID ist auf www.columbiathreadneedle.com erhältlich.

Angaben zur Vergütungspolitik

Diese Angaben werden in Bezug auf die Vergütungspolitik der Gruppe gemacht, wie sie für Threadneedle Management Luxembourg S.A. („der Manager“) im Hinblick auf die Richtlinie über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) und andere anwendbare Regeln und Vorschriften gilt.

Die Vergütungspolitik gilt für alle Tochtergesellschaften der Gesellschaft, die den Auflagen der OGAW-Richtlinie unterliegen, und wurde zuletzt im Juni 2022 vom Vergütungsausschuss genehmigt.

1. Der Vergütungsausschuss

Der Vergütungsausschuss von UK HoldCo („der Ausschuss“) ist ein Unterausschuss des Verwaltungsrats von UK HoldCo, der für die Entwicklung der Philosophie und der Ziele, die die Grundlage der Vergütungs- und Leistungsprogramme der Gruppe bilden, die Überprüfung und Genehmigung von Vergütungs- und Leistungsplänen, Richtlinien und Praktiken sowie für die Aufsicht und Genehmigung der Vergütung der Gruppe zuständig ist. Es wurde festgelegt, dass der Ausschuss unabhängig von den täglichen Geschäftsaufgaben der Gruppe sein muss. Seine Mitglieder sind Verwaltungsratsmitglieder der Gruppe, die von Ameriprise Financial, der Muttergesellschaft der Gruppe, ernannt werden.

Die derzeitigen Mitglieder des Ausschusses sind Walter Berman und William Turner. Sitzungen finden in der Regel im Januar, März, Juni, September und Dezember statt. Der Global Head of Reward fungiert als Sekretär des Ausschusses. Der Ausschuss kann bei Bedarf einen Mitarbeiter oder funktionellen Spezialisten der Muttergesellschaft zu einer Sitzung einladen, um es sich zu ermöglichen, seine Aufgaben ordnungsgemäß zu erfüllen. Zu diesen gehört es sicherzustellen, dass die Vergütung im Einklang mit dem effektiven Risikomanagement steht und nicht das Eingehen übermäßiger Risiken fördert.

Informationen für Anteilinhaber (ungeprüft)

(Fortsetzung)

2. Festlegung von Pools zur erfolgsorientierten Vergütung

Der Manager traf seine jährlichen Total Incentive Award-Entscheidungen aus separaten Pools, die das Immobiliengeschäft, die Vertriebseinheit, das Investmentgeschäft und die Support-Funktionen abdeckten und zu Governance- und Aufsichtszwecken auf der regionalen EMEA-Ebene zusammengefasst wurden. Diese Pools werden im Ermessen der Gesellschaft festgelegt, vorbehaltlich der endgültigen Beaufsichtigung und Zustimmung des Vergütungsausschusses. Die Pools für Special Incentive Plans (die „SIPs“) für die Geschäftsbereiche Immobilien, Vertrieb und Investments werden unter Bezugnahme auf vier ungewichtete Faktoren festgelegt: eine „Top-Down“-Beurteilung der Marktgepflogenheiten, der rechtlichen und aufsichtsrechtlichen Auflagen und anderer interner oder externer kontextueller Faktoren; eine „Bottom-Up“-Berechnung, die auf der Geschäftsleistung im Vergleich zur Plan- und Zielleistungsprämienebene des Unternehmens basiert (siehe „Leistungsbezogene Bezahlung“ weiter unten); die allgemeine finanzielle und strategische Leistung der Gruppe; und die finanzielle und strategische Leistung von Ameriprise Financial als Muttergesellschaft und Anteilinhaber der Gruppe. Die Mittel für unterstützende Funktionen sind Teil des globalen „AIA“-Plans, wobei die Mittel für die einzelnen Regionen und Geschäftsbereiche durch eine umfassende ausgewogene Beurteilung der Geschäftsbereiche im Kontext der Gesamtpformance der Ameriprise Financial Group bestimmt werden. Alle Pools werden zu dem im Laufe des Jahres aufrechterhaltenen Risiko- und Kontrollumfeld in Bezug gesetzt und können von oben nach unten angepasst werden, um diesbezüglich bedeutenden Aspekten Rechnung zu tragen. Der Ausschuss erhält während des gesamten Jahres zudem fortlaufend Berichte von der Risiko-Funktion bezüglich Risikobeurteilungen und allen Themen oder Bereichen, die mit dem Risikoccontrolling oder risikobezogenen Verhaltensbedenken in Zusammenhang stehen.

Der Ausschuss berücksichtigt alle diese Faktoren, um eine ausgewogene Entscheidung bezüglich seiner Beaufsichtigung und Genehmigung des Total Incentive-Pools für das betreffende Jahr zu treffen.

3. Festlegung individueller Total Incentive Awards

Individuelle Vergütungsentscheidungen im Rahmen aller Leistungsprämienpläne sind vollständig diskretionär, wenn auch stark beeinflusst von der jährlichen Leistungsbeurteilung und von bekannten Vergütungsniveaus des Marktes für vergleichbare Tätigkeiten sowie von den im Pool verfügbaren Mitteln. Der Bereich Risiko und Compliance stellt einen wichtigen Faktor für die endgültige Leistungsbewertung dar und stellt sicher, dass sich Bedenken in Bezug auf das Risiko- und anderes relevantes Verhalten in den Leistungsbeurteilungen und folglich in den Vergütungsempfehlungen widerspiegeln. Die Leiter des Bereichs Risiko und Compliance für die EMEA-Region berichten zudem direkt an den Vergütungsausschuss für den Leistungsprämienprozess, um sicherzustellen, dass der Ausschuss einen direkten Bericht erhält, auf dessen Grundlage er seine endgültigen Risikoanpassungsentscheidungen treffen kann.

Grundgehälter werden auf einem wettbewerbsfähigen Niveau gehalten, um sicherzustellen, dass es bei Bedarf möglich ist, keine Leistungsprämien zu gewähren.

Leistungsbezogene Bezahlung

Das Bottom-up-Element des Entscheidungsprozesses für den SIP-Pool misst die Team- und breitere Geschäftsleistung anhand wichtiger Geschäftsziele für jeden Bereich der Gruppe, darunter die längerfristige Anlagenperformance der Geschäftsbereiche Investments und Immobilien und ein Mix aus Brutto- und Nettoumsätzen des Geschäftsbereichs Vertrieb. Die Anlagenperformance wird anhand der Benchmarks und des Risikoprofils jedes Fonds beurteilt. Alle Auswirkungen dieser Beurteilungen auf die Bottom-up-Berechnung werden gedeckelt und über längere Zeiträume stärker gewichtet, damit Manager nicht dazu angeregt werden, übermäßige Risiken einzugehen, um die Pools für Leistungsprämien aufzustocken. Zwar sind die finanziellen und strategischen Ergebnisse der Gruppe und der Muttergesellschaft wichtige Faktoren für die Festlegung der Pools, das Modell ist aber so aufgebaut, dass sichergestellt ist, dass die Kernziele des Unternehmens, darunter die Erzielung der Anlagenperformance für seine Kunden, ein ausdrücklicher und signifikanter Treiber für die Pool-Festlegung in diesen Geschäftsbereichen sind.

Einzelne diskretionäre Prämien aus den verfügbaren Mitteln werden im Kontext wettbewerbsfähiger Leistungsprämienniveaus für die betreffende Tätigkeit stark von den Bewertungen der einzelnen Person anhand der Ziele und Führungserwartungen der Gruppe (unserer Werte) bestimmt, die jeweils separat auf einer 5-Punkte-Skala bewertet werden, um sicherzustellen, dass der Verhaltensbeurteilung die gebührende Bedeutung zukommt. Die Ziele konzentrieren sich auf die wichtigsten Ergebnisse für die Rolle in diesem Jahr, insbesondere auf die Erzielung von Anlagenperformance für Mitarbeiter des Investment- und des Immobilienbereichs: Alle Mitarbeiter werden auch im Hinblick auf ein obligatorisches Risikomanagement-Ziel verwaltet. Die Anlagenperformance, sofern für die Rolle relevant, wird anhand der Benchmark und des Risikoprofils jedes Fonds bewertet.

Bewertungen werden über das gesamte Unternehmen hinweg auf ihre Kohärenz geprüft, wobei die Leiter des Bereichs Risiko und Compliance für die Region EMEA nach Bedarf Beiträge leisten, um Ausgewogenheit und die gebührende Beachtung des Risikomanagements sicherzustellen. Für Verkaufs-, Immobilien- und Investitionsanreize gibt es keine vordefinierten Raster oder formelbasierten Prämien, die freiwillig sind, um alle relevanten Faktoren berücksichtigen und widerspiegeln zu können.

Informationen für Anteilinhaber (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Gewährung von Total Incentive Awards

Threadneedle glaubt, dass aufgeschobene Leistungsprämien für Höherverdienende und Risikoträger eine Frage guter Praxis sind und einen wichtigen Teil bei der Ausrichtung der Interessen wichtiger Mitarbeiter an den langfristigen Interessen von Kunden und Anteilhabern darstellen. In diesem Sinne können Total Incentive Awards für alle Mitarbeiter der Gruppe teilweise in Form von aufgeschobenen Prämien über das Programm Ameriprise Financial Long-Term Incentive Award („LTIA“) gewährt werden, und für dem Vergütungscode unterliegende Mitarbeiter/identifizierte Mitarbeiter sowie Mitarbeiter im Geschäftsbereich Investments durch ein Mittelaufschubprogramm. Aufgeschobene Zahlungen und die Gewährung von Prämien in Form von Instrumenten erfüllen die jeweils geltenden aufsichtsrechtlichen Auflagen.

Mitarbeiter, die die Anforderungen des Vergütungscode erfüllen, bzw. identifizierte Mitarbeiter und jene, die eine vergleichbare Stellung innehaben, unterliegen einem größeren Aufschub. 50 % der gesamten Anreizprämien werden in Form von fondsgebundenen Anteilen gewährt, die nach ihrer Gewährung einer Haltedauer unterliegen. Die fondsgebundenen Anteile sollen die Performance eines Querschnitts von Produkten und Anlageklassen innerhalb der Region widerspiegeln.

4. Identifizierte Mitarbeiter

Dem Vergütungscode unterliegende Mitarbeiter und identifizierte Mitarbeiter sind eingestuft als oberes Management, Personen mit wesentlichen Auswirkungen auf das Risikoprofil von OGAW, Personen innerhalb von Kontrollfunktionen und andere Mitarbeiter, deren Gesamtvergütung im selben Rahmen wie die von Angehörigen des oberen Managements und von Risikoträgern liegt, deren berufliche Aktivitäten wesentliche Auswirkungen auf die Risikoprofile des Managers oder die von ihm verwalteten Fonds haben. In der Praxis umfassen diese die genannten Fondsmanager der Fonds des Managers.

5. Offenlegung der Vergütungszahlung

Der Performance-Zeitraum für die Vergütung beruht auf dem Kalenderjahr.

Die von der Gruppe an 27 dem OGAW-V-Vergütungscode unterliegende Senior Manager im Hinblick auf ihre OGAW-Aktivitäten im Performance-Zeitraum 2022 gezahlte Gesamtvergütung belief sich auf 2,06 Mio. GBP, wovon 0,85 Mio. GBP auf feste und 1,21 Mio. GBP auf variable Vergütung entfielen. Die an andere dem OGAW-Vergütungscode unterliegende Mitarbeiter, deren Handlungen wesentliche Auswirkungen auf das Risikoprofil des Managers hatten, gezahlte Gesamtvergütung belief sich auf 6,27 Mio. GBP, wovon 2,66 Mio. GBP auf feste und 3,61 Mio. GBP auf variable Vergütung entfielen. Die an beauftragte Verwalter von als OGAW regulierten Fonds gezahlte Gesamtvergütung belief sich auf 0,99 Mio. GBP, davon waren 0,29 Mio. GBP feste und 0,70 Mio. GBP variable Komponenten.

Informationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)

Der Jahresbericht und der geprüfte Abschluss, der ungeprüfte Halbjahresbericht, der Bericht über die Veränderungen des Portfoliobestands in dem Jahr, die Satzung, der Verkaufsprospekt (Schweizer Version) und die KIID können auf Anfrage kostenlos bei den Geschäftsstellen der Vertretung und Zahlstelle der SICAV in der Schweiz, RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, Succursale de Zurich, Bleicherweg 7, CH-8027 Zürich, Schweiz, oder am eingetragenen Firmensitz der SICAV angefordert werden.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit gibt keinen Aufschluss über die aktuelle oder zukünftige Wertentwicklung, und bei den Daten zur Wertentwicklung sind Provisionen und Kosten im Rahmen der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen nicht berücksichtigt.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond								
AEC	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-17,59 %	-0,79 %	-2,48 %	8,26 %	9,67 %
AEH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-17,57 %	-0,79 %	-2,49 %	8,26 %	9,71 %
AKH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-17,24 %	-0,79 %	-2,26 %	8,26 %	9,87 %
ANH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-16,49 %	-0,79 %	-1,75 %	8,26 %	10,06 %
AU	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-15,69 %	-0,79 %	-1,57 %	8,26 %	11,36 %
AUP	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-15,69 %	-0,79 %	-1,57 %	8,26 %	11,36 %
DEC	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-18,19 %	-0,79 %	-3,21 %	8,26 %	8,90 %
DEH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-18,16 %	-0,79 %	-3,22 %	8,26 %	8,85 %
DU	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-16,31 %	-0,79 %	-2,30 %	8,26 %	10,53 %
DUP	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-16,32 %	-0,79 %	-2,30 %	8,26 %	10,53 %
IEC	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-17,41 %	-0,79 %	-2,29 %	8,26 %	9,92 %
IEH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-17,38 %	-0,79 %	-2,29 %	8,26 %	9,86 %
IEP	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-9,97 %	-0,79 %	6,08 %	8,26 %	2,20 %
IGC	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-16,25 %	-0,79 %	-1,63 %	8,26 %	10,24 %
IGH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-16,23 %	-0,79 %	-1,61 %	8,26 %	10,25 %
IKH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-17,03 %	-0,79 %	-1,95 %	8,26 %	10,10 %
INH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-16,27 %	-0,79 %	-1,47 %	8,26 %	10,39 %
IU	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-15,48 %	-0,79 %	-1,37 %	8,26 %	11,58 %
IUP	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-15,48 %	-0,79 %	-1,37 %	8,26 %	11,61 %
NEC	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-17,26 %	-0,79 %	-2,09 %	8,26 %	10,16 %
NEH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-17,27 %	-0,79 %	-2,10 %	8,26 %	10,08 %
NGC	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-16,11 %	-0,79 %	-1,41 %	8,26 %	10,51 %
NGH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-16,09 %	-0,79 %	-1,41 %	8,26 %	10,49 %
NU	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-15,35 %	-0,79 %	-1,17 %	8,26 %	11,80 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond								
<i>(Fortsetzung)</i>								
NUP	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-15,35 %	-0,79 %	-1,17 %	8,26 %	11,82 %
XEH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Oktober 2020	-14,11 %	-17,05 %	-0,79 %	-1,80 %	2,18 %	2,27 %
XFH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Oktober 2020	-14,11 %	-17,39 %	-0,79 %	-2,07 %	2,18 %	2,21 %
XGH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-15,85 %	-0,79 %	-1,11 %	8,26 %	10,81 %
XU	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Oktober 2020	-14,11 %	-15,09 %	-0,79 %	-0,87 %	2,18 %	2,48 %
ZEH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-17,38 %	-0,79 %	-2,23 %	8,26 %	9,97 %
ZFH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)	Wertentwicklung seit Auflegung am 14. Oktober 2020	-14,11 %	-17,80 %	-0,79 %	-2,66 %	2,17 %	2,11 %
ZGH	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-16,22 %	-0,79 %	-1,55 %	8,26 %	10,32 %
ZU	Bloomberg Capital Global Aggregate Corporates (USD Hedged)		-14,11 %	-15,48 %	-0,79 %	-1,32 %	8,26 %	11,63 %
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond								
AE	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-14,74 %	-1,08 %	-1,81 %	2,73 %	3,76 %
ANH	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-13,72 %	-1,08 %	-1,20 %	2,73 %	4,48 %
IE	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-14,33 %	-1,08 %	-1,22 %	2,73 %	4,39 %
IEP	iBoxx EUR Corporate Bond	Wertentwicklung seit Auflegung am 8. April 2021	-14,17 %	-14,43 %	-0,66 %	-0,97 %	k. A.	k. A.
INH	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-13,27 %	-1,08 %	-0,51 %	2,73 %	5,04 %
XE	iBoxx EUR Corporate Bond	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Oktober 2020	-14,17 %	-14,08 %	-1,08 %	-0,73 %	1,13 %	1,53 %
XFH	iBoxx EUR Corporate Bond	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Oktober 2020	-14,17 %	-14,50 %	-1,08 %	-1,05 %	1,13 %	1,48 %
XGH	iBoxx EUR Corporate Bond	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Oktober 2020	-14,17 %	-12,92 %	-1,08 %	-0,20 %	1,13 %	1,65 %
XUH	iBoxx EUR Corporate Bond	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Oktober 2020	-14,17 %	-12,29 %	-1,08 %	-0,04 %	1,13 %	1,72 %
ZE	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-14,53 %	-1,08 %	-1,45 %	2,73 %	4,29 %
ZFH	iBoxx EUR Corporate Bond	Wertentwicklung seit Auflegung am 14. Oktober 2020	-14,17 %	-15,00 %	-1,08 %	-1,72 %	1,27 %	1,51 %
1E	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-14,87 %	-1,08 %	-1,80 %	2,73 %	3,78 %
1G	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-10,04 %	-1,08 %	-7,89 %	2,73 %	9,62 %
2E	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-14,35 %	-1,08 %	-1,20 %	2,73 %	4,41 %
2G	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-9,59 %	-1,08 %	-7,36 %	2,73 %	10,26 %
3G	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-9,59 %	-1,08 %	-7,43 %	2,73 %	10,18 %
4E	iBoxx EUR Corporate Bond	Wertentwicklung seit Auflegung am 8. April 2020	-14,17 %	-13,92 %	-1,08 %	-0,70 %	9,46 %	10,73 %
4G	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-9,04 %	-1,08 %	-6,86 %	2,73 %	10,85 %
8E	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-14,39 %	-1,08 %	-1,24 %	2,73 %	4,37 %
8G	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-9,53 %	-1,08 %	-7,36 %	2,73 %	10,26 %
9G	iBoxx EUR Corporate Bond		-14,17 %	-9,62 %	-1,08 %	-7,46 %	2,73 %	10,22 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond								
AE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Mai 2020	-11,75 %	-12,21 %	3,25 %	1,46 %	14,26 %	11,30 %
AKH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-12,00 %	3,25 %	1,67 %	2,82 %	2,71 %
ANH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,18 %	3,25 %	2,17 %	2,82 %	2,68 %
IE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,55 %	3,25 %	2,27 %	2,82 %	3,43 %
IEP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,55 %	3,25 %	2,27 %	2,82 %	3,43 %
IKH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,23 %	3,25 %	2,48 %	2,82 %	3,32 %
INH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-10,42 %	3,25 %	2,93 %	2,82 %	3,36 %
XE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,01 %	3,25 %	3,00 %	2,82 %	4,15 %
ZE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,61 %	3,25 %	2,22 %	2,82 %	3,38 %
ZEP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,61 %	3,25 %	2,22 %	2,82 %	3,36 %
1E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-12,09 %	3,25 %	1,73 %	2,82 %	2,88 %
1EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-12,09 %	3,25 %	1,73 %	2,82 %	2,88 %
1G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-7,10 %	3,25 %	-4,58 %	2,82 %	8,68 %
1GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-7,09 %	3,25 %	-4,56 %	2,82 %	8,65 %
1UT	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-10,24 %	3,25 %	2,47 %	2,82 %	4,25 %
2E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,60 %	3,25 %	2,30 %	2,82 %	3,46 %
2EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,59 %	3,25 %	2,33 %	2,82 %	3,50 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond								
<i>(Fortsetzung)</i>								
2FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-12,03 %	3,25 %	1,99 %	2,82 %	3,12 %
2G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-6,65 %	3,25 %	-4,11 %	2,82 %	9,29 %
2GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-6,56 %	3,25 %	-3,99 %	2,82 %	9,36 %
3E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,55 %	3,25 %	2,35 %	2,82 %	3,51 %
3EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,55 %	3,25 %	2,35 %	2,82 %	3,51 %
3FC	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,98 %	3,25 %	2,03 %	2,82 %	3,16 %
3FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,98 %	3,25 %	2,04 %	2,82 %	3,18 %
3G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-6,53 %	3,25 %	-3,99 %	2,82 %	9,35 %
3GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-6,52 %	3,25 %	-3,98 %	2,82 %	9,32 %
4E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-10,93 %	3,25 %	3,07 %	2,82 %	4,24 %
4G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-5,90 %	3,25 %	-3,32 %	2,82 %	10,12 %
8E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,63 %	3,25 %	2,26 %	2,82 %	3,42 %
8EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,63 %	3,25 %	2,26 %	2,82 %	3,42 %
8FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-12,06 %	3,25 %	1,95 %	2,82 %	3,09 %
8G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-6,62 %	3,25 %	-4,08 %	2,82 %	9,25 %
8GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-6,61 %	3,25 %	-4,06 %	2,82 %	9,22 %
9E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,51 %	3,25 %	2,40 %	2,82 %	3,55 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond								
<i>(Fortsetzung)</i>								
9EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,51 %	3,25 %	2,40 %	2,82 %	3,55 %
9FC	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,86 %	3,25 %	2,10 %	2,82 %	3,19 %
9FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-11,85 %	3,25 %	2,08 %	2,82 %	3,22 %
9G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-6,48 %	3,25 %	-3,87 %	2,82 %	9,44 %
9GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained (Hedged to EUR)		-11,75 %	-6,43 %	3,25 %	-3,88 %	2,82 %	9,41 %
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond								
AE	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICHSEXZES		k. A.	-4,82 %	k. A.	1,82 %	0,62 %	1,31 %
AEP	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICHSEXZES		k. A.	-4,83 %	k. A.	1,82 %	0,62 %	1,31 %
AKH	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICHSEXZES		k. A.	-4,55 %	k. A.	2,11 %	0,62 %	1,43 %
ANH	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICHSEXZES		k. A.	-3,62 %	k. A.	2,55 %	0,62 %	1,64 %
IE	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICHSEXZES		k. A.	-4,44 %	k. A.	2,23 %	0,62 %	1,72 %
IEP	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICHSEXZES		k. A.	-4,44 %	k. A.	2,22 %	0,62 %	1,67 %
IGC	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICHSEXZES		k. A.	-3,15 %	k. A.	2,80 %	0,62 %	2,11 %
IGH	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICHSEXZES		k. A.	-3,20 %	k. A.	2,76 %	0,62 %	2,04 %
IKH	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICHSEXZES		k. A.	-4,18 %	k. A.	2,49 %	0,62 %	1,82 %
INH	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICHSEXZES		k. A.	-3,30 %	k. A.	2,92 %	0,62 %	2,02 %
XE	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICHSEXZES		k. A.	-4,06 %	k. A.	2,64 %	0,62 %	2,13 %
XGC	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICHSEXZES		k. A.	-2,71 %	k. A.	3,19 %	0,62 %	2,48 %
XGH	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICHSEXZES		k. A.	-2,67 %	k. A.	3,17 %	0,62 %	2,52 %
ZE	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICHSEXZES		k. A.	-4,53 %	k. A.	2,16 %	0,62 %	1,66 %
Threadneedle (Lux) - European Social Bond								
AE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. September 2020	-14,49 %	-15,43 %	-1,46 %	-2,38 %	1,52 %	1,36 %
AEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. September 2020	-14,49 %	-15,43 %	-1,46 %	-2,38 %	1,52 %	1,36 %
AFH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-14,49 %	-15,82 %	-0,62 %	-1,19 %	k. A.	k. A.
AKH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 14. Oktober 2020	-14,49 %	-15,00 %	-1,46 %	-1,93 %	1,04 %	1,03 %
ANH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 14. Oktober 2020	-14,49 %	-14,14 %	-1,46 %	-1,46 %	1,04 %	1,12 %
ASC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-14,49 %	-13,98 %	-0,62 %	-0,43 %	k. A.	k. A.
ASH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-14,49 %	-13,94 %	-0,62 %	-0,44 %	k. A.	k. A.
AUC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-14,49 %	-13,67 %	-0,62 %	-0,36 %	k. A.	k. A.

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - European Social Bond								
<i>(Fortsetzung)</i>								
AUH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-14,49 %	-13,69 %	-0,62 %	-0,33 %	k. A.	k. A.
ID	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49 %	-15,31 %	-1,46 %	-2,31 %	2,74 %	2,77 %
IE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49 %	-15,30 %	-1,46 %	-2,23 %	2,74 %	3,16 %
IEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49 %	-15,30 %	-1,46 %	-2,23 %	2,74 %	3,16 %
IFH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49 %	-15,74 %	-1,46 %	-2,56 %	2,74 %	2,78 %
IGH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-14,49 %	-14,19 %	-0,62 %	-0,45 %	k. A.	k. A.
IKH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49 %	-14,96 %	-1,46 %	-1,88 %	2,74 %	3,33 %
INH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49 %	-14,09 %	-1,46 %	-1,41 %	2,74 %	3,69 %
ISC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-14,49 %	-13,77 %	-0,62 %	-0,42 %	k. A.	k. A.
ISH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-14,49 %	-13,81 %	-0,62 %	-0,42 %	k. A.	k. A.
IUC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-14,49 %	-13,62 %	-0,62 %	-0,35 %	k. A.	k. A.
IUH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-14,49 %	-13,62 %	-0,62 %	-0,26 %	k. A.	k. A.
LE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49 %	-15,30 %	-1,46 %	-2,24 %	2,74 %	3,23 %
NEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49 %	-15,30 %	-1,46 %	-2,23 %	2,74 %	3,23 %
ZD	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49 %	-15,36 %	-1,46 %	-2,36 %	2,74 %	2,71 %
ZE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49 %	-15,34 %	-1,46 %	-2,28 %	2,74 %	3,11 %
ZEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49 %	-15,34 %	-1,46 %	-2,28 %	2,74 %	3,11 %
ZFH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-14,49 %	-15,79 %	-1,46 %	-2,60 %	2,74 %	2,76 %
ZGC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 3. April 2020	-14,49 %	-14,27 %	-1,46 %	-1,75 %	7,68 %	7,77 %
ZGH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 3. April 2020	-14,49 %	-14,25 %	-1,46 %	-1,75 %	7,68 %	7,78 %
ZUH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 12. Juni 2020	-14,49 %	-13,65 %	-1,46 %	-1,58 %	3,50 %	3,92 %
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond								
AE	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-10,90 %	0,86 %	-0,63 %	2,23 %	5,38 %
AEP	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-10,90 %	0,86 %	-0,63 %	2,23 %	5,38 %
AKH	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-10,69 %	0,86 %	-0,54 %	2,23 %	5,56 %
ANH	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-9,71 %	0,86 %	-0,13 %	2,23 %	5,97 %
AUH	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-9,17 %	0,86 %	-0,02 %	2,23 %	6,72 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond								
<i>(Fortsetzung)</i>								
DE	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-11,39 %	0,86 %	-1,18 %	2,23 %	4,80 %
DEP	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-11,39 %	0,86 %	-1,18 %	2,23 %	4,80 %
DUH	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-9,64 %	0,86 %	-0,65 %	2,23 %	6,04 %
IE	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-10,36 %	0,86 %	-0,04 %	2,23 %	6,01 %
INH	ICE BofA Custom Index		-11,32 %	-9,13 %	0,86 %	0,70 %	2,23 %	6,77 %
ZE	ICE BofA Custom Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 11. November 2021	-11,32 %	-10,58 %	-0,42 %	-0,40 %	k. A.	k. A.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds								
AEC	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-14,53 %	0,91 %	-2,47 %	7,13 %	6,21 %
AEH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-14,58 %	0,91 %	-2,43 %	7,13 %	6,22 %
AKH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-14,19 %	0,91 %	-2,12 %	7,13 %	6,31 %
ANH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-13,33 %	0,91 %	-1,71 %	7,13 %	6,15 %
ASH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-12,95 %	0,91 %	-1,60 %	7,13 %	7,35 %
AU	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-12,62 %	0,91 %	-1,54 %	7,13 %	7,90 %
AUP	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-12,62 %	0,91 %	-1,54 %	7,13 %	7,90 %
DEC	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-14,62 %	0,91 %	-2,57 %	7,13 %	6,10 %
DEH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-14,67 %	0,91 %	-2,53 %	7,13 %	6,12 %
DU	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-12,70 %	0,91 %	-1,64 %	7,13 %	7,79 %
IEC	JPM CEMBI Broad Diversified	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-12,26 %	-13,82 %	k. A.	-1,16 %	k. A.	k. A.
IEH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-13,89 %	0,91 %	-1,65 %	7,13 %	7,09 %
IU	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-11,92 %	0,91 %	-0,77 %	7,13 %	8,76 %
W	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-12,31 %	0,91 %	-1,20 %	7,13 %	8,27 %
WEH	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-14,27 %	0,91 %	-2,10 %	7,13 %	6,59 %
XUP	JPM CEMBI Broad Diversified		-12,26 %	-11,27 %	0,91 %	0,07 %	7,13 %	9,66 %
ZU	JPM CEMBI Broad Diversified	Wertentwicklung seit Auflegung am 11. November 2021	-12,26 %	-11,88 %	k. A.	0,01 %	k. A.	k. A.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt								
AEC	JPM EMBI Global		-16,45 %	-18,84 %	-1,51 %	-3,92 %	5,88 %	5,56 %
AEH	JPM EMBI Global		-16,45 %	-18,88 %	-1,51 %	-3,91 %	5,88 %	5,55 %
AKH	JPM EMBI Global		-16,45 %	-18,75 %	-1,51 %	-3,83 %	5,88 %	5,36 %
ANH	JPM EMBI Global		-16,45 %	-17,86 %	-1,51 %	-3,40 %	5,88 %	4,87 %
ASH	JPM EMBI Global		-16,45 %	-17,12 %	-1,51 %	-3,08 %	5,88 %	6,61 %
AU	JPM EMBI Global		-16,45 %	-16,64 %	-1,51 %	-2,96 %	5,88 %	7,29 %
AUP	JPM EMBI Global		-16,45 %	-16,64 %	-1,51 %	-2,96 %	5,88 %	7,29 %
DEH	JPM EMBI Global		-16,45 %	-18,94 %	-1,51 %	-4,02 %	5,88 %	5,44 %
DU	JPM EMBI Global		-16,45 %	-16,73 %	-1,51 %	-3,06 %	5,88 %	7,18 %
IEH	JPM EMBI Global		-16,45 %	-18,21 %	-1,51 %	-3,16 %	5,88 %	6,41 %
IU	JPM EMBI Global		-16,45 %	-15,97 %	-1,51 %	-2,45 %	5,88 %	7,98 %
SU	JPM EMBI Global		-16,45 %	-16,77 %	-1,51 %	-3,11 %	5,88 %	7,12 %
SUP	JPM EMBI Global		-16,45 %	-16,77 %	-1,51 %	-3,11 %	5,88 %	7,13 %
W	JPM EMBI Global		-16,45 %	-16,35 %	-1,51 %	-2,62 %	5,88 %	7,66 %
XUP	JPM EMBI Global		-16,45 %	-15,45 %	-1,51 %	-1,59 %	5,88 %	8,91 %
ZU	JPM EMBI Global		-16,45 %	-16,01 %	-1,51 %	-2,34 %	5,88 %	8,07 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds								
AEC	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-12,48 %	0,19 %	-2,58 %	4,79 %	2,68 %
AEH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-12,49 %	0,19 %	-2,59 %	4,79 %	2,69 %
AKH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-12,37 %	0,19 %	-2,33 %	4,79 %	2,65 %
ANH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-11,33 %	0,19 %	-1,88 %	4,79 %	2,90 %
ASC	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-10,75 %	0,19 %	-1,70 %	4,79 %	3,71 %
ASH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-10,77 %	0,19 %	-1,72 %	4,79 %	3,70 %
AU	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-10,41 %	0,19 %	-1,65 %	4,79 %	4,22 %
AUP	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-10,41 %	0,19 %	-1,65 %	4,79 %	4,22 %
DEH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-12,63 %	0,19 %	-2,73 %	4,79 %	2,54 %
DU	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-10,54 %	0,19 %	-1,79 %	4,79 %	4,07 %
IE	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-3,82 %	0,19 %	6,62 %	4,79 %	-3,68 %
IEH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-11,84 %	0,19 %	-1,84 %	4,79 %	3,45 %
XU	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-9,12 %	0,19 %	-0,21 %	4,79 %	5,75 %
XUP	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-9,12 %	0,19 %	-0,21 %	4,79 %	5,75 %
ZEH	JPM EMBI Global 3-5 Years		-10,28 %	-11,86 %	0,19 %	-1,90 %	4,79 %	3,38 %
ZU	JPM EMBI Global 3-5 Years	Wertentwicklung seit Auflegung am 11. November 2021	-10,28 %	-9,68 %	-1,11 %	-0,74 %	k. A.	k. A.
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond								
AEC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-13,36 %	5,27 %	2,57 %	6,10 %	3,32 %
AEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-13,37 %	5,27 %	2,56 %	6,10 %	3,33 %
AKH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-13,21 %	5,27 %	2,89 %	6,10 %	3,11 %
ANH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-12,52 %	5,27 %	3,26 %	6,10 %	2,96 %
ASH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-11,66 %	5,27 %	3,45 %	6,10 %	4,30 %
AU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-11,18 %	5,27 %	3,54 %	6,10 %	4,99 %
AUP	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-11,18 %	5,27 %	3,54 %	6,10 %	4,99 %
DEC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-13,52 %	5,27 %	2,37 %	6,10 %	3,13 %
DEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-13,55 %	5,27 %	2,38 %	6,10 %	3,13 %
DU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-11,36 %	5,27 %	3,34 %	6,10 %	4,78 %
IEC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-12,61 %	5,27 %	3,48 %	6,10 %	4,30 %
IEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-12,60 %	5,27 %	3,49 %	6,10 %	4,22 %
IKH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-12,38 %	5,27 %	3,80 %	6,10 %	4,08 %
INH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-11,63 %	5,27 %	4,19 %	6,10 %	3,97 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond								
<i>(Fortsetzung)</i>								
ISC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained	Wertentwicklung seit Auflegung am 29. Juli 2021	-11,10 %	-10,88 %	1,38 %	1,52 %	k. A.	k. A.
IU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-10,42 %	5,27 %	4,48 %	6,10 %	5,94 %
TEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-12,59 %	5,27 %	3,48 %	6,10 %	4,22 %
XUP	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-9,96 %	5,27 %	5,06 %	6,10 %	6,51 %
ZFH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-13,06 %	5,27 %	2,91 %	6,10 %	3,70 %
ZGH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-11,68 %	5,27 %	3,79 %	6,10 %	4,13 %
ZU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		-11,10 %	-10,59 %	5,27 %	4,22 %	6,10 %	5,67 %
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond								
AEH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-15,70 %	-0,61 %	-0,82 %	5,67 %	2,44 %
AKH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-15,25 %	-0,61 %	-0,50 %	5,67 %	2,68 %
AS	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-14,29 %	-0,61 %	2,06 %	5,67 %	2,32 %
ASC	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-14,13 %	-0,61 %	0,03 %	5,67 %	3,65 %
ASH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-14,15 %	-0,61 %	0,01 %	5,67 %	3,61 %
AU	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-13,84 %	-0,61 %	0,07 %	5,67 %	4,10 %
AUP	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-13,84 %	-0,61 %	0,07 %	5,67 %	4,10 %
AVC	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-14,54 %	-0,61 %	-0,50 %	5,67 %	3,16 %
AVH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-14,59 %	-0,61 %	-0,38 %	5,67 %	3,10 %
DEH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-15,95 %	-0,61 %	-1,14 %	5,67 %	2,21 %
IEH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-15,20 %	-0,61 %	-0,24 %	5,67 %	3,15 %
IGH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-14,00 %	-0,61 %	0,41 %	5,67 %	3,60 %
ISH	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-13,64 %	-0,61 %	0,66 %	5,67 %	4,34 %
IU	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-13,32 %	-0,61 %	0,67 %	5,67 %	4,80 %
XU	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-12,97 %	-0,61 %	1,07 %	5,67 %	5,46 %
ZU	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-13,39 %	-0,61 %	0,57 %	5,67 %	4,70 %
ZUP	JPM Asia Credit Diversified		-11,41 %	-13,44 %	-0,61 %	0,55 %	5,67 %	4,63 %
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return								
AE	MUICP (EU CPI)		9,31 %	-10,68 %	4,76 %	6,86 %	-0,25 %	5,21 %
AEP	MUICP (EU CPI)		9,31 %	-10,80 %	4,76 %	6,81 %	-0,25 %	5,16 %
DE	MUICP (EU CPI)		9,31 %	-11,35 %	4,76 %	6,06 %	-0,25 %	4,43 %
IE	MUICP (EU CPI)		9,31 %	-10,05 %	4,76 %	7,61 %	-0,25 %	5,95 %
IEP	MUICP (EU CPI)		9,31 %	-9,82 %	4,76 %	7,61 %	-0,25 %	5,92 %
LE	MUICP (EU CPI)		9,31 %	-9,92 %	4,76 %	7,77 %	-0,25 %	6,11 %
LEP	MUICP (EU CPI)		9,31 %	-9,73 %	4,76 %	7,82 %	-0,25 %	6,10 %
ZE	MUICP (EU CPI)		9,31 %	-10,33 %	4,76 %	7,41 %	-0,25 %	5,74 %
ZEP	MUICP (EU CPI)		9,31 %	-10,31 %	4,76 %	7,42 %	-0,25 %	5,75 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return								
AEC	US CPI		6,42 %	-16,15 %	7,12 %	-0,68 %	k. A.	9,60 %
AEH	US CPI		6,42 %	-16,15 %	7,12 %	-0,67 %	k. A.	9,60 %
AKH	US CPI		6,42 %	-16,11 %	7,12 %	-0,44 %	k. A.	9,59 %
AU	US CPI		6,42 %	-13,80 %	7,12 %	0,32 %	k. A.	11,46 %
AUP	US CPI		6,42 %	-13,80 %	7,12 %	0,32 %	k. A.	11,46 %
DEH	US CPI		6,42 %	-16,69 %	7,12 %	-1,32 %	k. A.	8,89 %
DU	US CPI		6,42 %	-14,36 %	7,12 %	-0,33 %	k. A.	10,74 %
IEH	US CPI		6,42 %	-15,48 %	7,12 %	-0,09 %	k. A.	10,26 %
IGH	US CPI		6,42 %	-14,49 %	7,12 %	0,66 %	k. A.	10,78 %
IU	US CPI		6,42 %	-13,19 %	7,12 %	1,03 %	k. A.	12,24 %
W	US CPI		6,42 %	-13,89 %	7,12 %	0,22 %	k. A.	11,35 %
ZU	US CPI	Wertentwicklung seit Auflegung am 11. November 2021	6,42 %	-13,38 %	0,99 %	-1,89 %	k. A.	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income								
AE	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-5,86 %	1,03 %	15,61 %	0,66 %	-6,12 %
AEC	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-13,92 %	1,03 %	6,43 %	0,66 %	0,64 %
AEH	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-13,90 %	1,03 %	6,35 %	0,66 %	0,61 %
AEP	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-5,87 %	1,03 %	15,61 %	0,66 %	-6,12 %
AS	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-12,32 %	1,03 %	9,39 %	0,66 %	0,33 %
ASC	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-12,17 %	1,03 %	7,33 %	0,66 %	1,53 %
ASH	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-12,17 %	1,03 %	7,27 %	0,66 %	1,46 %
ASP	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-12,11 %	1,03 %	9,60 %	0,66 %	0,57 %
AU	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-11,65 %	1,03 %	7,45 %	0,66 %	2,33 %
AUM	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-11,65 %	1,03 %	7,45 %	0,66 %	2,32 %
AUP	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-11,65 %	1,03 %	7,45 %	0,66 %	2,33 %
DEC	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-14,56 %	1,03 %	5,63 %	0,66 %	-0,14 %
DEH	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-14,54 %	1,03 %	5,55 %	0,66 %	-0,14 %
DEP	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-6,57 %	1,03 %	14,74 %	0,66 %	-6,82 %
DU	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-12,31 %	1,03 %	6,65 %	0,66 %	1,56 %
DUP	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-12,31 %	1,03 %	6,65 %	0,66 %	1,56 %
ZE	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-5,50 %	1,03 %	16,17 %	0,66 %	-5,65 %
ZEC	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-13,64 %	1,03 %	6,93 %	0,66 %	1,08 %
ZEH	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-13,43 %	1,03 %	6,91 %	0,66 %	1,11 %
ZFH	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-13,93 %	1,03 %	6,59 %	0,66 %	0,89 %
ZU	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-11,20 %	1,03 %	7,98 %	0,66 %	2,84 %
ZUP	Zusammengesetzte Benchmark		-12,89 %	-11,31 %	1,03 %	7,90 %	0,66 %	2,72 %
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities								
AE	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-19,74 %	-28,89 %	-2,22 %	-2,97 %	20,31 %	24,15 %
AEC	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-19,74 %	-35,44 %	-2,22 %	-10,90 %	20,31 %	29,65 %
AEH	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-19,74 %	-35,45 %	-2,22 %	-10,94 %	20,31 %	29,65 %
AU	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-19,74 %	-33,26 %	-2,22 %	-9,83 %	20,31 %	30,12 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities								
<i>(Fortsetzung)</i>								
AUP	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-19,74 %	-33,24 %	-2,22 %	-9,84 %	20,31 %	30,12 %
IE	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-19,74 %	-28,17 %	-2,22 %	-2,10 %	20,31 %	24,47 %
IEH	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-19,74 %	-34,77 %	-2,22 %	-10,11 %	20,31 %	29,96 %
IG	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-19,74 %	-24,11 %	-2,22 %	-8,13 %	20,31 %	21,79 %
IU	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-19,74 %	-32,55 %	-2,22 %	-8,98 %	20,31 %	30,48 %
LE	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-19,74 %	-27,98 %	-2,22 %	-1,75 %	20,31 %	24,58 %
LG	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-19,74 %	-23,85 %	-2,22 %	-7,89 %	20,31 %	21,90 %
XU	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-19,74 %	-32,14 %	-2,22 %	-8,41 %	20,31 %	30,71 %
ZE	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-19,74 %	-28,31 %	-2,22 %	-2,23 %	20,31 %	24,40 %
ZEC	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-19,74 %	-34,99 %	-2,22 %	-10,21 %	20,31 %	29,89 %
ZEH	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-19,74 %	-34,98 %	-2,22 %	-10,24 %	20,31 %	29,89 %
ZU	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-19,74 %	-32,75 %	-2,22 %	-9,18 %	20,31 %	30,39 %
ZUP	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-19,74 %	-32,76 %	-2,22 %	-9,18 %	20,31 %	30,38 %
Threadneedle (Lux) - Global Focus								
AEH	MSCI AC World		-17,96 %	-29,05 %	19,04 %	21,21 %	16,82 %	24,63 %
AEP	MSCI AC World		-17,96 %	-21,68 %	19,04 %	31,78 %	16,82 %	16,31 %
ASH	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. April 2022	-6,07 %	-8,11 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
AU	MSCI AC World		-17,96 %	-26,50 %	19,04 %	22,48 %	16,82 %	26,78 %
AUP	MSCI AC World		-17,96 %	-26,50 %	19,04 %	22,48 %	16,82 %	26,78 %
DEH	MSCI AC World		-17,96 %	-29,57 %	19,04 %	20,31 %	16,82 %	23,70 %
DU	MSCI AC World		-17,96 %	-27,05 %	19,04 %	21,57 %	16,82 %	25,84 %
IE	MSCI AC World		-17,96 %	-21,01 %	19,04 %	32,91 %	16,82 %	17,30 %
IEH	MSCI AC World		-17,96 %	-28,45 %	19,04 %	22,24 %	16,82 %	25,69 %
IU	MSCI AC World		-17,96 %	-25,87 %	19,04 %	23,53 %	16,82 %	27,86 %
IUP	MSCI AC World		-17,96 %	-25,87 %	19,04 %	23,52 %	16,82 %	27,82 %
W	MSCI AC World		-17,96 %	-26,45 %	19,04 %	22,54 %	16,82 %	26,85 %
XU	MSCI AC World		-17,96 %	-25,33 %	19,04 %	24,52 %	16,82 %	28,89 %
ZE	MSCI AC World		-17,96 %	-21,07 %	19,04 %	32,77 %	16,82 %	17,19 %
ZEH	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. September 2020	-17,96 %	-28,46 %	19,04 %	22,14 %	12,83 %	9,88 %
ZEP	MSCI AC World		-17,96 %	-21,08 %	19,04 %	32,77 %	16,82 %	17,19 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilsklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Global Focus								
<i>(Fortsetzung)</i>								
ZFH	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. September 2020	-17,96 %	-28,49 %	19,04 %	21,76 %	12,83 %	9,80 %
ZG	MSCI AC World		-17,96 %	-16,60 %	19,04 %	24,54 %	16,82 %	23,79 %
ZU	MSCI AC World		-17,96 %	-25,93 %	19,04 %	23,40 %	16,82 %	27,74 %
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities								
AEH	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-36,61 %	-2,22 %	-10,32 %	18,69 %	31,52 %
AU	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-34,37 %	-2,22 %	-9,25 %	18,69 %	33,80 %
DEH	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-37,08 %	-2,22 %	-10,97 %	18,69 %	30,51 %
DU	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-34,86 %	-2,22 %	-9,93 %	18,69 %	32,80 %
IE	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Mai 2020	-19,74 %	-29,48 %	-2,22 %	-1,53 %	46,87 %	47,45 %
IEH	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-36,03 %	-2,22 %	-9,54 %	18,69 %	32,58 %
IU	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-33,81 %	-2,22 %	-8,48 %	18,69 %	34,94 %
XU	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 17. März 2022	-8,81 %	-14,47 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZU	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-33,87 %	-2,22 %	-8,57 %	18,69 %	34,80 %
1E	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-30,04 %	-2,22 %	-2,27 %	18,69 %	22,86 %
1U	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-34,34 %	-2,22 %	-9,17 %	18,69 %	33,92 %
2E	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-29,61 %	-2,22 %	-1,68 %	18,69 %	23,61 %
2U	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-33,94 %	-2,22 %	-8,60 %	18,69 %	34,80 %
8E	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-29,66 %	-2,22 %	-1,71 %	18,69 %	23,56 %
8U	MSCI Emerging Markets		-19,74 %	-33,97 %	-2,22 %	-8,65 %	18,69 %	34,69 %
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income								
AEC	MSCI AC World		-17,96 %	-15,94 %	19,04 %	14,84 %	16,82 %	1,52 %
AUP	MSCI AC World		-17,96 %	-13,10 %	19,04 %	16,13 %	16,82 %	3,23 %
DEC	MSCI AC World		-17,96 %	-16,44 %	19,04 %	14,27 %	16,82 %	0,97 %
DUP	MSCI AC World		-17,96 %	-13,48 %	19,04 %	15,58 %	16,82 %	2,71 %
IU	MSCI AC World		-17,96 %	-12,30 %	19,04 %	17,04 %	16,82 %	4,09 %
TE	MSCI AC World		-17,96 %	-6,62 %	19,04 %	25,75 %	16,82 %	-4,66 %
ZU	MSCI AC World		-17,96 %	-12,43 %	19,04 %	16,99 %	16,82 %	4,02 %
1E	MSCI AC World		-17,96 %	-7,23 %	19,04 %	25,12 %	16,82 %	-5,14 %
1EP	MSCI AC World		-17,96 %	-7,24 %	19,04 %	25,12 %	16,82 %	-5,14 %
1SC	MSCI AC World		-17,96 %	-13,77 %	19,04 %	15,95 %	16,82 %	2,22 %
1SH	MSCI AC World		-17,96 %	-13,79 %	19,04 %	15,95 %	16,82 %	2,18 %
1ST	MSCI AC World		-17,96 %	-13,79 %	19,04 %	15,98 %	16,82 %	2,19 %
1U	MSCI AC World		-17,96 %	-12,94 %	19,04 %	16,29 %	16,82 %	3,40 %
1UP	MSCI AC World		-17,96 %	-12,94 %	19,04 %	16,29 %	16,82 %	3,40 %
1VT	MSCI AC World		-17,96 %	-14,93 %	19,04 %	15,25 %	16,82 %	0,40 %
2E	MSCI AC World		-17,96 %	-6,67 %	19,04 %	25,88 %	16,82 %	-4,56 %
2EP	MSCI AC World		-17,96 %	-6,63 %	19,04 %	25,84 %	16,82 %	-4,53 %
2U	MSCI AC World		-17,96 %	-12,41 %	19,04 %	17,00 %	16,82 %	4,04 %
2UP	MSCI AC World		-17,96 %	-12,37 %	19,04 %	17,03 %	16,82 %	4,03 %
3E	MSCI AC World		-17,96 %	-6,54 %	19,04 %	26,06 %	16,82 %	-4,43 %
3EP	MSCI AC World		-17,96 %	-6,55 %	19,04 %	26,06 %	16,82 %	-4,42 %
3U	MSCI AC World		-17,96 %	-12,29 %	19,04 %	17,16 %	16,82 %	4,18 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilsklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income								
<i>(Fortsetzung)</i>								
3UP	MSCI AC World		-17,96 %	-12,28 %	19,04 %	17,16 %	16,82 %	4,18 %
8E	MSCI AC World		-17,96 %	-6,70 %	19,04 %	25,83 %	16,82 %	-4,60 %
8EP	MSCI AC World		-17,96 %	-6,74 %	19,04 %	25,83 %	16,82 %	-4,63 %
8U	MSCI AC World		-17,96 %	-12,44 %	19,04 %	16,95 %	16,82 %	3,99 %
8UP	MSCI AC World		-17,96 %	-12,44 %	19,04 %	16,95 %	16,82 %	3,99 %
9E	MSCI AC World		-17,96 %	-6,47 %	19,04 %	26,09 %	16,82 %	-4,33 %
9EP	MSCI AC World		-17,96 %	-6,46 %	19,04 %	26,10 %	16,82 %	-4,31 %
9U	MSCI AC World		-17,96 %	-12,21 %	19,04 %	17,22 %	16,82 %	4,33 %
9UP	MSCI AC World		-17,96 %	-12,19 %	19,04 %	17,31 %	16,82 %	4,27 %
Threadneedle (Lux) - Global Select								
IU	MSCI AC World		-17,96 %	-25,08 %	19,04 %	13,86 %	16,82 %	21,20 %
ZU	MSCI AC World		-17,96 %	-25,14 %	19,04 %	13,80 %	16,82 %	21,08 %
1E	MSCI AC World		-17,96 %	-20,79 %	19,04 %	21,61 %	16,82 %	10,40 %
1U	MSCI AC World		-17,96 %	-25,66 %	19,04 %	13,03 %	16,82 %	20,34 %
2E	MSCI AC World		-17,96 %	-20,26 %	19,04 %	22,39 %	16,82 %	11,10 %
2U	MSCI AC World		-17,96 %	-25,20 %	19,04 %	13,72 %	16,82 %	21,07 %
3U	MSCI AC World		-17,96 %	-25,08 %	19,04 %	13,91 %	16,82 %	21,28 %
8E	MSCI AC World		-17,96 %	-20,33 %	19,04 %	22,31 %	16,82 %	11,03 %
8U	MSCI AC World		-17,96 %	-25,23 %	19,04 %	13,67 %	16,82 %	21,03 %
9U	MSCI AC World		-17,96 %	-25,04 %	19,04 %	13,96 %	16,82 %	21,33 %
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies								
AE	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-30,73 %	25,00 %	22,14 %	6,85 %	27,53 %
AEP	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-30,73 %	25,00 %	22,14 %	6,85 %	27,53 %
AK	MSCI World Small Cap	Wertentwicklung seit Auflegung am 10. Januar 2020	-13,02 %	-25,18 %	25,00 %	25,15 %	5,98 %	19,04 %
AUP	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-34,99 %	25,00 %	13,53 %	6,85 %	39,00 %
DE	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-31,07 %	25,00 %	21,53 %	6,85 %	26,89 %
IE	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-30,14 %	25,00 %	23,19 %	6,85 %	28,62 %
IEP	MSCI World Small Cap	Wertentwicklung seit Auflegung am 29. Juli 2020	-13,02 %	-30,14 %	25,00 %	23,19 %	22,69 %	25,47 %
NE	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-30,00 %	25,00 %	23,43 %	6,85 %	28,88 %
XE	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-29,58 %	25,00 %	24,17 %	6,85 %	29,65 %
XFH	MSCI World Small Cap	Wertentwicklung seit Auflegung am 11. November 2020	-13,02 %	-29,72 %	25,00 %	23,86 %	8,50 %	9,06 %
XG	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-25,51 %	25,00 %	16,50 %	6,85 %	36,89 %
XGH	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-28,82 %	25,00 %	24,53 %	6,85 %	28,85 %
XU	MSCI World Small Cap	Wertentwicklung seit Auflegung am 11. November 2020	-13,02 %	-33,91 %	25,00 %	15,41 %	8,50 %	12,89 %
ZE	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-30,21 %	25,00 %	23,06 %	6,85 %	28,49 %
ZFH	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-30,44 %	25,00 %	22,60 %	6,85 %	28,16 %
ZG	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-26,25 %	25,00 %	15,43 %	6,85 %	35,73 %
ZGH	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-29,52 %	25,00 %	23,29 %	6,85 %	27,70 %
ZU	MSCI World Small Cap		-13,02 %	-34,50 %	25,00 %	14,38 %	6,85 %	40,06 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - American								
AEH	S&P 500		-18,11 %	-23,95 %	28,71 %	23,73 %	18,40 %	18,60 %
AU	S&P 500		-18,11 %	-21,30 %	28,71 %	24,99 %	18,40 %	20,51 %
DEH	S&P 500		-18,11 %	-24,26 %	28,71 %	23,30 %	18,40 %	18,17 %
DU	S&P 500		-18,11 %	-21,58 %	28,71 %	24,56 %	18,40 %	20,08 %
IEH	S&P 500		-18,11 %	-23,32 %	28,71 %	24,85 %	18,40 %	19,66 %
IU	S&P 500		-18,11 %	-20,59 %	28,71 %	26,12 %	18,40 %	21,59 %
W	S&P 500		-18,11 %	-21,07 %	28,71 %	25,37 %	18,40 %	20,87 %
ZE	S&P 500		-18,11 %	-15,51 %	28,71 %	35,57 %	18,40 %	11,43 %
ZEH	S&P 500		-18,11 %	-23,37 %	28,71 %	24,73 %	18,40 %	19,56 %
ZU	S&P 500		-18,11 %	-20,75 %	28,71 %	26,02 %	18,40 %	21,42 %
1E	S&P 500		-18,11 %	-16,04 %	28,71 %	34,66 %	18,40 %	10,70 %
1EH	S&P 500		-18,11 %	-23,87 %	28,71 %	23,90 %	18,40 %	18,71 %
1EP	S&P 500		-18,11 %	-16,04 %	28,71 %	34,65 %	18,40 %	10,70 %
1U	S&P 500		-18,11 %	-21,20 %	28,71 %	25,15 %	18,40 %	20,66 %
2E	S&P 500		-18,11 %	-15,52 %	28,71 %	35,48 %	18,40 %	11,37 %
2U	S&P 500		-18,11 %	-20,72 %	28,71 %	25,92 %	18,40 %	21,40 %
3EH	S&P 500		-18,11 %	-23,29 %	28,71 %	24,90 %	18,40 %	19,63 %
3U	S&P 500		-18,11 %	-20,58 %	28,71 %	26,15 %	18,40 %	21,62 %
8E	S&P 500		-18,11 %	-15,56 %	28,71 %	35,43 %	18,40 %	11,33 %
8U	S&P 500		-18,11 %	-20,75 %	28,71 %	25,87 %	18,40 %	21,35 %
9EH	S&P 500		-18,11 %	-23,27 %	28,71 %	24,99 %	18,40 %	19,78 %
9U	S&P 500		-18,11 %	-20,54 %	28,71 %	26,20 %	18,40 %	21,67 %
Threadneedle (Lux) - American Select								
AD	S&P 500		-18,11 %	-19,29 %	28,71 %	29,73 %	18,40 %	13,52 %
AEH	S&P 500		-18,11 %	-26,87 %	28,71 %	19,50 %	18,40 %	22,24 %
AN	S&P 500		-18,11 %	-15,37 %	28,71 %	24,30 %	18,40 %	21,04 %
AU	S&P 500		-18,11 %	-24,19 %	28,71 %	20,68 %	18,40 %	24,22 %
DEH	S&P 500		-18,11 %	-27,38 %	28,71 %	18,57 %	18,40 %	21,33 %
DU	S&P 500		-18,11 %	-24,76 %	28,71 %	19,78 %	18,40 %	23,29 %
ID	S&P 500		-18,11 %	-18,57 %	28,71 %	30,76 %	18,40 %	14,42 %
IE	S&P 500		-18,11 %	-18,58 %	28,71 %	30,84 %	18,40 %	14,82 %
IEH	S&P 500		-18,11 %	-26,26 %	28,71 %	20,45 %	18,40 %	23,20 %
IN	S&P 500		-18,11 %	-14,62 %	28,71 %	25,26 %	18,40 %	21,96 %
W	S&P 500		-18,11 %	-24,15 %	28,71 %	20,74 %	18,40 %	24,28 %
ZEH	S&P 500		-18,11 %	-26,40 %	28,71 %	20,30 %	18,40 %	23,14 %
ZU	S&P 500		-18,11 %	-23,66 %	28,71 %	21,52 %	18,40 %	25,09 %
1E	S&P 500		-18,11 %	-19,12 %	28,71 %	30,01 %	18,40 %	14,11 %
1EH	S&P 500		-18,11 %	-26,76 %	28,71 %	19,66 %	18,40 %	22,39 %
1EP	S&P 500		-18,11 %	-19,12 %	28,71 %	30,00 %	18,40 %	14,11 %
1U	S&P 500		-18,11 %	-24,09 %	28,71 %	20,83 %	18,40 %	24,38 %
2EH	S&P 500		-18,11 %	-26,31 %	28,71 %	20,44 %	18,40 %	23,19 %
2U	S&P 500		-18,11 %	-23,63 %	28,71 %	21,59 %	18,40 %	25,16 %
3E	S&P 500		-18,11 %	-18,47 %	28,71 %	31,05 %	18,40 %	15,02 %
3U	S&P 500		-18,11 %	-23,48 %	28,71 %	21,80 %	18,40 %	25,37 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - American Select								
<i>(Fortsetzung)</i>								
8EH	S&P 500		-18,11 %	-26,33 %	28,71 %	20,29 %	18,40 %	23,12 %
8U	S&P 500		-18,11 %	-23,66 %	28,71 %	21,52 %	18,40 %	25,09 %
9E	S&P 500		-18,11 %	-18,46 %	28,71 %	31,17 %	18,40 %	15,12 %
9U	S&P 500		-18,11 %	-23,45 %	28,71 %	21,87 %	18,40 %	25,46 %
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies								
AEH	Russell 2500		-18,37 %	-20,84 %	18,18 %	22,12 %	19,99 %	28,44 %
ASH	Russell 2500	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. April 2022	-6,16 %	-7,59 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
AU	Russell 2500		-18,37 %	-18,04 %	18,18 %	23,60 %	19,99 %	30,64 %
DEH	Russell 2500		-18,37 %	-21,28 %	18,18 %	21,51 %	19,99 %	27,81 %
DU	Russell 2500		-18,37 %	-18,45 %	18,18 %	22,99 %	19,99 %	30,06 %
IE	Russell 2500		-18,37 %	-11,93 %	18,18 %	34,11 %	19,99 %	20,86 %
IU	Russell 2500		-18,37 %	-17,35 %	18,18 %	24,66 %	19,99 %	31,79 %
ZU	Russell 2500		-18,37 %	-17,43 %	18,18 %	24,54 %	19,99 %	31,71 %
1E	Russell 2500		-18,37 %	-12,57 %	18,18 %	33,15 %	19,99 %	20,05 %
1EP	Russell 2500		-18,37 %	-12,57 %	18,18 %	33,14 %	19,99 %	20,06 %
1U	Russell 2500		-18,37 %	-17,95 %	18,18 %	23,75 %	19,99 %	30,86 %
2U	Russell 2500		-18,37 %	-17,44 %	18,18 %	24,51 %	19,99 %	31,66 %
3EH	Russell 2500		-18,37 %	-19,99 %	18,18 %	23,19 %	19,99 %	29,63 %
3U	Russell 2500		-18,37 %	-17,33 %	18,18 %	24,68 %	19,99 %	31,84 %
8U	Russell 2500		-18,37 %	-17,48 %	18,18 %	24,46 %	19,99 %	31,61 %
9EH	Russell 2500		-18,37 %	-20,13 %	18,18 %	23,20 %	19,99 %	29,69 %
9U	Russell 2500		-18,37 %	-17,30 %	18,18 %	24,73 %	19,99 %	31,89 %
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity								
AE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-19,96 %	-2,65 %	-0,40 %	22,75 %	13,91 %
AF	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,81 %	-2,65 %	-4,62 %	22,75 %	13,34 %
AS	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-25,26 %	-2,65 %	-5,58 %	22,75 %	21,97 %
ASH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-25,75 %	-2,65 %	-7,80 %	22,75 %	22,68 %
AU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-24,88 %	-2,65 %	-7,43 %	22,75 %	24,14 %
DE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-20,55 %	-2,65 %	-1,14 %	22,75 %	13,04 %
IF	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-22,96 %	-2,65 %	-3,76 %	22,75 %	14,26 %
ISH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-25,04 %	-2,65 %	-7,00 %	22,75 %	23,72 %
IU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-24,23 %	-2,65 %	-6,64 %	22,75 %	25,20 %
XU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,63 %	-2,65 %	-5,89 %	22,75 %	26,21 %
XUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,63 %	-2,65 %	-5,89 %	22,75 %	26,21 %
ZE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-19,40 %	-2,65 %	0,35 %	22,75 %	14,75 %
ZEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-26,72 %	-2,65 %	-7,83 %	22,75 %	22,88 %
ZF	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,20 %	-2,65 %	-3,87 %	22,75 %	14,21 %
ZG	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-14,83 %	-2,65 %	-5,85 %	22,75 %	21,19 %
ZU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-24,31 %	-2,65 %	-6,73 %	22,75 %	25,08 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilsklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Asia Equities								
AE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 10. Juni 2021	-17,19 %	-19,62 %	-8,64 %	-3,78 %	k. A.	k. A.
AEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 10. Juni 2021	-17,19 %	-26,93 %	-8,64 %	-10,74 %	k. A.	k. A.
DE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 10. Juni 2021	-17,19 %	-20,00 %	-8,64 %	-4,02 %	k. A.	k. A.
DEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 10. Juni 2021	-17,19 %	-27,28 %	-8,64 %	-10,98 %	k. A.	k. A.
IE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-18,82 %	-2,65 %	2,96 %	22,75 %	17,53 %
IU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,81 %	-2,65 %	-4,31 %	22,75 %	28,11 %
ZU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,89 %	-2,65 %	-4,40 %	22,75 %	27,99 %
1E	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-19,43 %	-2,65 %	2,19 %	22,75 %	16,65 %
1U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-24,38 %	-2,65 %	-5,02 %	22,75 %	27,15 %
2E	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-18,89 %	-2,65 %	2,82 %	22,75 %	17,36 %
2U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,92 %	-2,65 %	-4,44 %	22,75 %	27,93 %
3U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,81 %	-2,65 %	-4,31 %	22,75 %	28,11 %
8E	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-18,97 %	-2,65 %	2,78 %	22,75 %	17,25 %
8U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,95 %	-2,65 %	-4,48 %	22,75 %	27,88 %
9U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-23,78 %	-2,65 %	-4,27 %	22,75 %	28,16 %
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities								
AEC	S&P 500		-18,11 %	-22,47 %	28,71 %	20,75 %	18,40 %	18,72 %
AEH	S&P 500		-18,11 %	-22,43 %	28,71 %	20,75 %	18,40 %	18,55 %
AU	S&P 500		-18,11 %	-19,79 %	28,71 %	22,01 %	18,40 %	20,48 %
AUP	S&P 500		-18,11 %	-19,79 %	28,71 %	22,01 %	18,40 %	20,48 %
DU	S&P 500		-18,11 %	-20,19 %	28,71 %	21,40 %	18,40 %	19,88 %
IU	S&P 500		-18,11 %	-19,15 %	28,71 %	22,99 %	18,40 %	21,45 %
XS	S&P 500		-18,11 %	-18,79 %	28,71 %	26,59 %	18,40 %	20,54 %
XSH	S&P 500		-18,11 %	-19,24 %	28,71 %	23,81 %	18,40 %	21,24 %
ZEH	S&P 500		-18,11 %	-21,85 %	28,71 %	21,65 %	18,40 %	19,39 %
ZFH	S&P 500		-18,11 %	-21,90 %	28,71 %	21,29 %	18,40 %	19,27 %
ZGH	S&P 500		-18,11 %	-21,03 %	28,71 %	22,11 %	18,40 %	18,83 %
ZU	S&P 500		-18,11 %	-19,19 %	28,71 %	22,93 %	18,40 %	21,39 %
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities								
AE	S&P 500		-18,11 %	-14,00 %	28,71 %	43,84 %	18,40 %	-0,94 %
AEH	S&P 500		-18,11 %	-21,86 %	28,71 %	32,34 %	18,40 %	6,15 %
AU	S&P 500		-18,11 %	-19,23 %	28,71 %	33,69 %	18,40 %	7,97 %
AUP	S&P 500		-18,11 %	-19,21 %	28,71 %	33,70 %	18,40 %	7,97 %
DE	S&P 500		-18,11 %	-14,17 %	28,71 %	43,55 %	18,40 %	-1,14 %
DEH	S&P 500		-18,11 %	-22,02 %	28,71 %	32,08 %	18,40 %	5,98 %
DU	S&P 500		-18,11 %	-19,45 %	28,71 %	33,42 %	18,40 %	7,76 %
IE	S&P 500		-18,11 %	-13,73 %	28,71 %	44,35 %	18,40 %	-0,64 %
IEC	S&P 500		-18,11 %	-21,68 %	28,71 %	32,81 %	18,40 %	6,54 %
IEH	S&P 500		-18,11 %	-21,69 %	28,71 %	32,84 %	18,40 %	6,50 %
IFH	S&P 500		-18,11 %	-21,68 %	28,71 %	32,50 %	18,40 %	6,38 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilsklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities								
<i>(Fortsetzung)</i>								
IG	S&P 500		-18,11 %	-8,80 %	28,71 %	35,45 %	18,40 %	5,05 %
IU	S&P 500		-18,11 %	-19,03 %	28,71 %	34,19 %	18,40 %	8,35 %
NE	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. September 2020	-18,11 %	-13,50 %	28,71 %	44,70 %	12,39 %	7,24 %
NG	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. September 2020	-18,11 %	-8,67 %	28,71 %	35,62 %	12,39 %	5,28 %
NU	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. September 2020	-18,11 %	-18,88 %	28,71 %	34,41 %	12,39 %	11,13 %
XG	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 20. Mai 2020	-18,11 %	-8,56 %	28,71 %	35,73 %	29,86 %	5,63 %
ZEH	S&P 500		-18,11 %	-21,75 %	28,71 %	32,69 %	18,40 %	6,44 %
ZFH	S&P 500		-18,11 %	-21,69 %	28,71 %	32,38 %	18,40 %	6,24 %
ZU	S&P 500		-18,11 %	-19,09 %	28,71 %	34,02 %	18,40 %	8,24 %
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities								
AE	MSCI Europe		-8,92 %	-18,93 %	25,85 %	28,58 %	-2,82 %	6,41 %
ASH	MSCI Europe		-8,92 %	-17,14 %	25,85 %	29,32 %	-2,82 %	6,82 %
AUH	MSCI Europe		-8,92 %	-16,35 %	25,85 %	29,60 %	-2,82 %	7,77 %
DE	MSCI Europe		-8,92 %	-19,09 %	25,85 %	28,32 %	-2,82 %	6,08 %
IE	MSCI Europe		-8,92 %	-18,32 %	25,85 %	29,55 %	-2,82 %	7,29 %
W	MSCI Europe		-8,92 %	-19,06 %	25,85 %	28,32 %	-2,82 %	6,40 %
XE	MSCI Europe		-8,92 %	-17,75 %	25,85 %	30,39 %	-2,82 %	8,12 %
ZE	MSCI Europe	Wertentwicklung seit Auflegung am 15. Juli 2021	-8,92 %	-18,50 %	6,81 %	9,50 %	k. A.	k. A.
ZUH	MSCI Europe		-8,92 %	-15,90 %	25,85 %	30,33 %	-2,82 %	8,53 %
1E	MSCI Europe		-8,92 %	-18,93 %	25,85 %	28,61 %	-2,82 %	6,47 %
1EP	MSCI Europe		-8,92 %	-18,94 %	25,85 %	28,57 %	-2,82 %	6,41 %
1G	MSCI Europe		-8,92 %	-14,34 %	25,85 %	20,63 %	-2,82 %	12,48 %
1GP	MSCI Europe		-8,92 %	-14,30 %	25,85 %	20,59 %	-2,82 %	12,43 %
2E	MSCI Europe		-8,92 %	-18,57 %	25,85 %	29,19 %	-2,82 %	7,11 %
2G	MSCI Europe		-8,92 %	-13,95 %	25,85 %	21,18 %	-2,82 %	13,15 %
2U	MSCI Europe		-8,92 %	-23,52 %	25,85 %	20,14 %	-2,82 %	16,81 %
3E	MSCI Europe		-8,92 %	-18,45 %	25,85 %	29,36 %	-2,82 %	7,26 %
3G	MSCI Europe		-8,92 %	-13,83 %	25,85 %	21,35 %	-2,82 %	13,31 %
3GP	MSCI Europe		-8,92 %	-13,81 %	25,85 %	21,38 %	-2,82 %	13,26 %
4E	MSCI Europe		-8,92 %	-17,75 %	25,85 %	30,48 %	-2,82 %	8,19 %
4G	MSCI Europe		-8,92 %	-13,06 %	25,85 %	22,45 %	-2,82 %	14,32 %
8E	MSCI Europe		-8,92 %	-18,60 %	25,85 %	29,13 %	-2,82 %	7,07 %
8G	MSCI Europe		-8,92 %	-13,98 %	25,85 %	21,13 %	-2,82 %	13,11 %
8U	MSCI Europe		-8,92 %	-23,55 %	25,85 %	20,13 %	-2,82 %	16,78 %
9E	MSCI Europe		-8,92 %	-18,40 %	25,85 %	29,42 %	-2,82 %	7,45 %
9G	MSCI Europe		-8,92 %	-13,79 %	25,85 %	21,38 %	-2,82 %	13,41 %
9GP	MSCI Europe		-8,92 %	-13,75 %	25,85 %	21,39 %	-2,82 %	13,41 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend								
AE	MSCI Europe		-8,92 %	-16,35 %	25,85 %	20,28 %	-2,82 %	0,02 %
AEP	MSCI Europe		-8,92 %	-16,35 %	25,85 %	20,27 %	-2,82 %	0,05 %
AUP	MSCI Europe		-8,92 %	-21,57 %	25,85 %	11,75 %	-2,82 %	8,99 %
DE	MSCI Europe		-8,92 %	-16,65 %	25,85 %	19,85 %	-2,82 %	-0,35 %
DEP	MSCI Europe		-8,92 %	-16,65 %	25,85 %	19,85 %	-2,82 %	-0,32 %
IE	MSCI Europe		-8,92 %	-15,39 %	25,85 %	21,42 %	-2,82 %	0,86 %
IEP	MSCI Europe		-8,92 %	-15,39 %	25,85 %	21,42 %	-2,82 %	0,89 %
ZE	MSCI Europe		-8,92 %	-15,81 %	25,85 %	21,18 %	-2,82 %	0,80 %
ZEP	MSCI Europe		-8,92 %	-15,72 %	25,85 %	21,18 %	-2,82 %	0,76 %
1E	MSCI Europe		-8,92 %	-16,27 %	25,85 %	20,39 %	-2,82 %	0,15 %
1EP	MSCI Europe		-8,92 %	-16,27 %	25,85 %	20,38 %	-2,82 %	0,15 %
1G	MSCI Europe		-8,92 %	-11,52 %	25,85 %	12,93 %	-2,82 %	5,79 %
1GP	MSCI Europe		-8,92 %	-11,53 %	25,85 %	12,92 %	-2,82 %	5,78 %
2E	MSCI Europe		-8,92 %	-15,76 %	25,85 %	21,13 %	-2,82 %	0,76 %
2EP	MSCI Europe		-8,92 %	-15,71 %	25,85 %	21,24 %	-2,82 %	0,78 %
2G	MSCI Europe		-8,92 %	-10,94 %	25,85 %	13,71 %	-2,82 %	6,50 %
2GP	MSCI Europe		-8,92 %	-10,94 %	25,85 %	13,72 %	-2,82 %	6,48 %
3EP	MSCI Europe		-8,92 %	-15,64 %	25,85 %	21,30 %	-2,82 %	0,90 %
3G	MSCI Europe		-8,92 %	-10,85 %	25,85 %	13,77 %	-2,82 %	6,59 %
3GP	MSCI Europe		-8,92 %	-10,87 %	25,85 %	13,78 %	-2,82 %	6,58 %
4GP	MSCI Europe		-8,92 %	-10,10 %	25,85 %	14,76 %	-2,82 %	7,50 %
8E	MSCI Europe		-8,92 %	-15,79 %	25,85 %	21,08 %	-2,82 %	0,72 %
8EP	MSCI Europe		-8,92 %	-15,80 %	25,85 %	21,08 %	-2,82 %	0,71 %
8G	MSCI Europe		-8,92 %	-11,02 %	25,85 %	13,57 %	-2,82 %	6,40 %
8GP	MSCI Europe		-8,92 %	-11,02 %	25,85 %	13,57 %	-2,82 %	6,38 %
9EP	MSCI Europe		-8,92 %	-15,54 %	25,85 %	21,37 %	-2,82 %	1,04 %
9G	MSCI Europe		-8,92 %	-10,81 %	25,85 %	13,83 %	-2,82 %	6,65 %
9GP	MSCI Europe		-8,92 %	-10,78 %	25,85 %	13,78 %	-2,82 %	6,69 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities								
AE	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-35,76 %	23,41 %	22,58 %	7,78 %	13,08 %
ASH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,25 %	23,41 %	23,34 %	7,78 %	13,61 %
AUH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-33,53 %	23,41 %	23,69 %	7,78 %	14,73 %
DE	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-36,33 %	23,41 %	21,48 %	7,78 %	12,07 %
DUH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,16 %	23,41 %	22,60 %	7,78 %	13,74 %
IE	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-35,27 %	23,41 %	23,50 %	7,78 %	13,93 %
W	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-35,79 %	23,41 %	22,52 %	7,78 %	13,03 %
XE	EMIX Smaller European Companies	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2022	-10,26 %	-14,98 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZE	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-35,27 %	23,41 %	23,50 %	7,78 %	13,93 %
ZFH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-35,41 %	23,41 %	23,07 %	7,78 %	13,72 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies								
IE	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,00 %	23,41 %	20,83 %	7,78 %	9,80 %
ZE	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,10 %	23,41 %	20,65 %	7,78 %	9,63 %
1E	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,51 %	23,41 %	19,91 %	7,78 %	8,96 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies								
<i>(Fortsetzung)</i>								
1EP	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,51 %	23,41 %	19,91 %	7,78 %	8,96 %
1FH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,62 %	23,41 %	19,48 %	7,78 %	8,77 %
1G	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-30,79 %	23,41 %	12,47 %	7,78 %	15,10 %
1UH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-32,25 %	23,41 %	20,95 %	7,78 %	10,56 %
2E	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,08 %	23,41 %	20,69 %	7,78 %	9,67 %
2G	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-30,36 %	23,41 %	13,25 %	7,78 %	15,91 %
3E	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-33,97 %	23,41 %	20,88 %	7,78 %	9,84 %
3EP	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-33,97 %	23,41 %	20,88 %	7,78 %	9,84 %
3FH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,09 %	23,41 %	20,44 %	7,78 %	9,65 %
3G	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-30,23 %	23,41 %	13,39 %	7,78 %	16,03 %
3GP	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-30,23 %	23,41 %	13,39 %	7,78 %	16,02 %
3UH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-31,70 %	23,41 %	21,93 %	7,78 %	11,45 %
4E	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-33,42 %	23,41 %	21,90 %	7,78 %	10,77 %
4G	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-29,64 %	23,41 %	14,34 %	7,78 %	17,01 %
8E	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,11 %	23,41 %	20,64 %	7,78 %	9,62 %
8G	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-30,37 %	23,41 %	13,16 %	7,78 %	15,80 %
9E	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-33,95 %	23,41 %	20,93 %	7,78 %	9,89 %
9EP	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-33,88 %	23,41 %	20,99 %	7,78 %	9,99 %
9FH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-34,06 %	23,41 %	20,47 %	7,78 %	9,72 %
9G	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-30,20 %	23,41 %	13,43 %	7,78 %	16,08 %
9GP	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-30,11 %	23,41 %	13,48 %	7,78 %	16,16 %
9UH	EMIX Smaller European Companies		-22,89 %	-31,67 %	23,41 %	21,99 %	7,78 %	11,48 %
Threadneedle (Lux) - European Select								
AE	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-22,44 %	25,16 %	25,17 %	2,83 %	8,47 %
AGH	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-21,55 %	25,16 %	25,60 %	2,83 %	8,30 %
AUH	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-19,94 %	25,16 %	26,16 %	2,83 %	9,89 %
DUH	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-20,38 %	25,16 %	25,49 %	2,83 %	9,28 %
IE	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-21,78 %	25,16 %	26,23 %	2,83 %	9,40 %
ZE	FTSE World Europe ex UK	Wertentwicklung seit Auflegung am 14. Oktober 2021	-11,97 %	-21,93 %	6,24 %	5,96 %	k. A.	k. A.
ZG	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-17,42 %	25,16 %	18,29 %	2,83 %	15,45 %
ZGH	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-20,94 %	25,16 %	26,53 %	2,83 %	9,08 %
1E	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-22,32 %	25,16 %	25,35 %	2,83 %	8,63 %
1EP	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-22,32 %	25,16 %	25,35 %	2,83 %	8,63 %
1SH	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-20,58 %	25,16 %	26,12 %	2,83 %	9,20 %
1U	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-27,10 %	25,16 %	16,51 %	2,83 %	18,41 %
1UH	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-19,79 %	25,16 %	26,35 %	2,83 %	10,09 %
2E	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-21,86 %	25,16 %	26,09 %	2,83 %	9,28 %
2EP	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-21,84 %	25,16 %	26,12 %	2,83 %	9,35 %
3E	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-21,72 %	25,16 %	26,32 %	2,83 %	9,47 %
3U	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-26,54 %	25,16 %	17,41 %	2,83 %	19,33 %
8E	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-21,89 %	25,16 %	26,04 %	2,83 %	9,23 %
8EP	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-21,89 %	25,16 %	26,04 %	2,83 %	9,23 %
9E	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-21,69 %	25,16 %	26,37 %	2,83 %	9,52 %
9U	FTSE World Europe ex UK		-11,97 %	-26,50 %	25,16 %	17,50 %	2,83 %	19,47 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies								
IE	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-29,90 %	23,02 %	22,87 %	12,55 %	14,97 %
ZE	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-30,00 %	23,02 %	22,69 %	12,55 %	14,80 %
1E	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-30,44 %	23,02 %	21,93 %	12,55 %	14,09 %
1EP	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-30,44 %	23,02 %	21,93 %	12,55 %	14,09 %
1FH	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-30,53 %	23,02 %	21,45 %	12,55 %	13,84 %
2E	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-29,98 %	23,02 %	22,73 %	12,55 %	14,83 %
3E	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-29,88 %	23,02 %	22,90 %	12,55 %	14,99 %
3EP	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-29,88 %	23,02 %	22,90 %	12,55 %	14,99 %
3FH	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-30,03 %	23,02 %	22,41 %	12,55 %	14,74 %
8E	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-30,01 %	23,02 %	22,68 %	12,55 %	14,78 %
9E	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-29,86 %	23,02 %	22,95 %	12,55 %	15,04 %
9EP	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-29,86 %	23,02 %	22,95 %	12,55 %	15,04 %
9FH	EMIX Smaller European Companies ex UK		-21,57 %	-30,02 %	23,02 %	22,45 %	12,55 %	14,77 %
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income								
AEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-19,13 %	-2,65 %	0,42 %	22,75 %	21,55 %
AU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-16,48 %	-2,65 %	1,49 %	22,75 %	23,68 %
AUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-16,48 %	-2,65 %	1,49 %	22,75 %	23,68 %
DEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-19,69 %	-2,65 %	-0,34 %	22,75 %	20,64 %
DU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-17,10 %	-2,65 %	0,74 %	22,75 %	22,76 %
DUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-17,10 %	-2,65 %	0,74 %	22,75 %	22,76 %
IEP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-10,26 %	-2,65 %	10,12 %	22,75 %	14,36 %
IU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-15,73 %	-2,65 %	2,29 %	22,75 %	24,68 %
W	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-16,65 %	-2,65 %	1,29 %	22,75 %	23,43 %
XU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-15,09 %	-2,65 %	3,18 %	22,75 %	25,74 %
XUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-15,09 %	-2,65 %	3,18 %	22,75 %	25,74 %
ZG	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-5,37 %	-2,65 %	3,16 %	22,75 %	20,82 %
ZGH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-17,58 %	-2,65 %	1,50 %	22,75 %	21,94 %
ZGP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-5,39 %	-2,65 %	3,16 %	22,75 %	20,76 %
ZU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 11. November 2021	-17,19 %	-15,93 %	-2,63 %	1,62 %	k. A.	k. A.
ZUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-17,19 %	-15,85 %	-2,65 %	2,26 %	22,75 %	24,61 %
Threadneedle (Lux) - Global Technology								
AEH	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-34,58 %	30,15 %	36,06 %	44,26 %	40,63 %
AS	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-32,40 %	30,15 %	40,24 %	44,26 %	40,53 %
AU	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-32,05 %	30,15 %	37,48 %	44,26 %	42,98 %
AUP	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-32,05 %	30,15 %	37,48 %	44,26 %	42,98 %
BU	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-32,32 %	30,15 %	36,93 %	44,26 %	42,41 %
DEH	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-34,77 %	30,15 %	35,58 %	44,26 %	40,18 %
DU	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-32,28 %	30,15 %	37,00 %	44,26 %	42,48 %
IE	MSCI World Information Technology	Wertentwicklung seit Auflegung am 10. Januar 2020	-30,60 %	-26,94 %	30,15 %	49,26 %	40,01 %	27,46 %
IEH	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-34,00 %	30,15 %	37,27 %	44,26 %	41,91 %
IG	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-22,79 %	30,15 %	40,01 %	44,26 %	39,81 %
IU	MSCI World Information Technology	Wertentwicklung seit Auflegung am 10. Januar 2020	-30,60 %	-31,43 %	30,15 %	38,72 %	40,01 %	40,48 %
ZEH	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-34,05 %	30,15 %	37,14 %	44,26 %	41,73 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Global Technology								
<i>(Fortsetzung)</i>								
ZFH	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-33,94 %	30,15 %	36,74 %	44,26 %	41,68 %
ZG	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-22,87 %	30,15 %	39,88 %	44,26 %	39,67 %
ZU	MSCI World Information Technology		-30,60 %	-31,50 %	30,15 %	38,58 %	44,26 %	44,12 %
Threadneedle (Lux) - UK Equities								
AE	FTSE All Share	Wertentwicklung seit der Auflegung am 12. Februar 2020	0,34 %	-11,85 %	18,32 %	16,67 %	-9,32 %	-15,31 %
AEH	FTSE All Share		0,34 %	-8,20 %	18,32 %	8,76 %	-9,82 %	-11,08 %
AFH	FTSE All Share		0,34 %	-8,21 %	18,32 %	8,55 %	-9,82 %	-11,06 %
AG	FTSE All Share		0,34 %	-6,85 %	18,32 %	9,44 %	-9,82 %	-11,26 %
AGP	FTSE All Share		0,34 %	-6,85 %	18,32 %	9,44 %	-9,82 %	-11,26 %
DEH	FTSE All Share		0,34 %	-8,90 %	18,32 %	7,90 %	-9,82 %	-11,77 %
DG	FTSE All Share		0,34 %	-7,59 %	18,32 %	8,56 %	-9,82 %	-11,97 %
IE	FTSE All Share		0,34 %	-11,01 %	18,32 %	17,84 %	-9,82 %	-15,11 %
IEH	FTSE All Share		0,34 %	-7,32 %	18,32 %	9,79 %	-9,82 %	-10,24 %
IG	FTSE All Share		0,34 %	-5,96 %	18,32 %	10,48 %	-9,82 %	-10,41 %
IGP	FTSE All Share		0,34 %	-5,96 %	18,32 %	10,48 %	-9,82 %	-10,41 %
NEH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	0,34 %	-7,06 %	18,32 %	10,02 %	14,13 %	18,52 %
NFH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	0,34 %	-7,10 %	18,32 %	9,83 %	14,13 %	18,55 %
NG	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	0,34 %	-5,80 %	18,32 %	10,72 %	14,13 %	18,66 %
NGP	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	0,34 %	-5,71 %	18,32 %	10,75 %	14,13 %	18,66 %
NUH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	0,34 %	-4,31 %	18,32 %	11,11 %	14,13 %	18,86 %
TEH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	0,34 %	-7,10 %	18,32 %	9,99 %	14,13 %	18,52 %
TFH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	0,34 %	-7,14 %	18,32 %	9,77 %	14,13 %	18,55 %
TG	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	0,34 %	-5,76 %	18,32 %	10,72 %	14,13 %	18,66 %
TGP	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	0,34 %	-5,77 %	18,32 %	10,72 %	14,13 %	18,66 %
TUH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	0,34 %	-4,32 %	18,32 %	11,08 %	14,13 %	18,86 %
ZE	FTSE All Share	Wertentwicklung seit der Auflegung am 12. Februar 2020	0,34 %	-11,21 %	18,32 %	17,53 %	-9,32 %	-14,76 %
ZEH	FTSE All Share		0,34 %	-7,52 %	18,32 %	9,58 %	-9,82 %	-10,44 %
ZFH	FTSE All Share		0,34 %	-7,53 %	18,32 %	9,39 %	-9,82 %	-10,43 %
ZG	FTSE All Share		0,34 %	-6,15 %	18,32 %	10,26 %	-9,82 %	-10,59 %
ZGP	FTSE All Share		0,34 %	-6,15 %	18,32 %	10,26 %	-9,82 %	-10,59 %
ZUH	FTSE All Share	War vom 24. September 2020 bis zum 20. November 2020 inaktiv	0,34 %	-4,70 %	18,32 %	10,65 %	2,92 %	4,04 %
3EH	FTSE All Share		0,34 %	-7,35 %	18,32 %	9,78 %	-9,82 %	-10,25 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - UK Equities								
<i>(Fortsetzung)</i>								
3FH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit 24. November 2020	0,34 %	-7,37 %	18,32 %	9,60 %	2,80 %	4,44 %
3UH	FTSE All Share		0,34 %	-4,58 %	18,32 %	10,85 %	-9,82 %	-8,79 %
9EH	FTSE All Share		0,34 %	-7,24 %	18,32 %	9,80 %	-9,82 %	-10,27 %
9EP	FTSE All Share		0,34 %	-10,99 %	18,32 %	17,80 %	-9,82 %	-15,17 %
9FH	FTSE All Share		0,34 %	-7,33 %	18,32 %	9,64 %	-9,82 %	-10,23 %
9G	FTSE All Share		0,34 %	-5,94 %	18,32 %	10,50 %	-9,82 %	-10,40 %
9UH	FTSE All Share		0,34 %	-4,63 %	18,32 %	10,89 %	-9,82 %	-8,85 %
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income								
AE	FTSE All Share		0,34 %	-8,75 %	18,32 %	25,96 %	-9,82 %	-12,97 %
AEC	FTSE All Share		0,34 %	-4,98 %	18,32 %	17,40 %	-9,82 %	-8,16 %
AEH	FTSE All Share		0,34 %	-4,99 %	18,32 %	17,39 %	-9,82 %	-8,19 %
AG	FTSE All Share		0,34 %	-3,58 %	18,32 %	18,15 %	-9,82 %	-8,07 %
ASC	FTSE All Share		0,34 %	-3,02 %	18,32 %	18,24 %	-9,82 %	-7,63 %
AUC	FTSE All Share		0,34 %	-2,35 %	18,32 %	18,42 %	-9,82 %	-6,82 %
DE	FTSE All Share		0,34 %	-9,43 %	18,32 %	25,02 %	-9,82 %	-13,62 %
DEC	FTSE All Share		0,34 %	-5,68 %	18,32 %	16,41 %	-9,82 %	-8,95 %
DEH	FTSE All Share		0,34 %	-5,69 %	18,32 %	16,49 %	-9,82 %	-8,86 %
DG	FTSE All Share		0,34 %	-4,30 %	18,32 %	17,27 %	-9,82 %	-8,76 %
DGP	FTSE All Share		0,34 %	-4,32 %	18,32 %	17,15 %	-9,82 %	-8,79 %
IE	FTSE All Share		0,34 %	-7,88 %	18,32 %	27,16 %	-9,82 %	-12,14 %
IEH	FTSE All Share		0,34 %	-4,18 %	18,32 %	18,49 %	-9,82 %	-7,33 %
IG	FTSE All Share		0,34 %	-2,66 %	18,32 %	19,27 %	-9,82 %	-7,19 %
IGP	FTSE All Share		0,34 %	-2,66 %	18,32 %	19,28 %	-9,82 %	-7,19 %
IU	FTSE All Share		0,34 %	-13,55 %	18,32 %	18,18 %	-9,82 %	-4,23 %
IUH	FTSE All Share		0,34 %	-1,30 %	18,32 %	19,70 %	-9,82 %	-5,72 %
LG	FTSE All Share		0,34 %	-2,51 %	18,32 %	19,45 %	-9,82 %	-7,05 %
LGP	FTSE All Share		0,34 %	-2,51 %	18,32 %	19,45 %	-9,82 %	-7,05 %
ZE	FTSE All Share		0,34 %	-8,07 %	18,32 %	26,90 %	-9,82 %	-12,32 %
ZEH	FTSE All Share		0,34 %	-4,34 %	18,32 %	18,22 %	-9,82 %	-7,49 %
ZFH	FTSE All Share		0,34 %	-4,41 %	18,32 %	17,97 %	-9,82 %	-7,62 %
ZG	FTSE All Share		0,34 %	-2,85 %	18,32 %	19,04 %	-9,82 %	-7,38 %
ZGP	FTSE All Share		0,34 %	-2,85 %	18,32 %	19,04 %	-9,82 %	-7,38 %
ZUH	FTSE All Share		0,34 %	-1,63 %	18,32 %	19,33 %	-9,82 %	-6,85 %
1EH	FTSE All Share		0,34 %	-4,86 %	18,32 %	17,55 %	-9,82 %	-8,07 %
1FH	FTSE All Share		0,34 %	-4,97 %	18,32 %	17,27 %	-9,82 %	-8,17 %
1UH	FTSE All Share		0,34 %	-2,17 %	18,32 %	18,62 %	-9,82 %	-6,65 %
3EH	FTSE All Share		0,34 %	-4,18 %	18,32 %	18,43 %	-9,82 %	-7,32 %
3FH	FTSE All Share		0,34 %	-4,31 %	18,32 %	18,17 %	-9,82 %	-7,46 %
3UH	FTSE All Share		0,34 %	-1,43 %	18,32 %	19,53 %	-9,82 %	-5,91 %
9EH	FTSE All Share		0,34 %	-4,12 %	18,32 %	18,50 %	-9,82 %	-7,29 %
9FH	FTSE All Share		0,34 %	-4,27 %	18,32 %	18,14 %	-9,82 %	-7,44 %
9G	FTSE All Share		0,34 %	-2,65 %	18,32 %	19,29 %	-9,82 %	-7,18 %
9UH	FTSE All Share		0,34 %	-1,40 %	18,32 %	19,57 %	-9,82 %	-5,90 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity								
IU	MSCI EFM Africa ex-ZA 10/40		k. A.	-5,78 %	11,30 %	0,43 %	0,95 %	-7,63 %
ZU	MSCI EFM Africa ex-ZA 10/40		k. A.	-5,78 %	11,30 %	0,43 %	0,95 %	-7,63 %
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha								
AEH	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-10,05 %	0,13 %	1,63 %	0,66 %	-1,27 %
AFH	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-10,30 %	0,13 %	1,36 %	0,66 %	-1,50 %
AGH	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-8,84 %	0,13 %	2,32 %	0,66 %	-0,78 %
AU	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-8,04 %	0,13 %	2,61 %	0,66 %	0,00 %
DEH	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-10,56 %	0,13 %	1,13 %	0,66 %	-1,74 %
DU	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-8,50 %	0,13 %	2,10 %	0,66 %	-0,51 %
IEH	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-9,33 %	0,13 %	2,51 %	0,66 %	-0,41 %
IGH	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-8,08 %	0,13 %	2,92 %	0,66 %	0,01 %
IU	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-7,26 %	0,13 %	3,23 %	0,66 %	0,85 %
XGH	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-7,32 %	0,13 %	4,04 %	0,66 %	0,79 %
ZE	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-1,30 %	0,13 %	11,23 %	0,66 %	-7,50 %
ZEH	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-9,58 %	0,13 %	2,40 %	0,66 %	-0,47 %
ZGH	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-8,15 %	0,13 %	3,14 %	0,66 %	-0,07 %
ZU	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		1,15 %	-7,36 %	0,13 %	3,03 %	0,66 %	0,76 %
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities								
AE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat	Wertentwicklung seit Auflegung am 5. August 2021	-0,11 %	-4,47 %	-0,24 %	-1,02 %	k. A.	k. A.
IE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat	Wertentwicklung seit Auflegung am 5. August 2021	-0,11 %	-3,96 %	-0,24 %	-0,82 %	k. A.	k. A.
ZE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-4,03 %	-0,65 %	-0,48 %	-0,62 %	0,72 %
1E	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-4,48 %	-0,65 %	-0,88 %	-0,62 %	0,35 %
1EP	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-4,48 %	-0,65 %	-0,88 %	-0,62 %	0,35 %
1GH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-2,99 %	-0,65 %	-0,36 %	-0,62 %	0,84 %
1UH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-2,78 %	-0,65 %	-0,17 %	-0,62 %	1,55 %
2E	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-3,90 %	-0,65 %	-0,27 %	-0,62 %	0,96 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities								
<i>(Fortsetzung)</i>								
2EP	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-3,90 %	-0,65 %	-0,18 %	-0,62 %	1,05 %
2GC	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-2,35 %	-0,65 %	0,28 %	-0,62 %	1,55 %
2GH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-2,39 %	-0,65 %	0,26 %	-0,62 %	1,47 %
4GH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-1,91 %	-0,65 %	0,75 %	-0,62 %	1,99 %
8E	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-3,94 %	-0,65 %	-0,31 %	-0,62 %	0,92 %
8EP	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-3,94 %	-0,65 %	-0,31 %	-0,62 %	0,92 %
8GC	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-2,42 %	-0,65 %	0,25 %	-0,62 %	1,44 %
8GH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-2,41 %	-0,65 %	0,22 %	-0,62 %	1,45 %
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities								
AE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-4,74 %	-0,65 %	-1,41 %	-0,62 %	1,24 %
AFH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-5,23 %	-0,65 %	-1,58 %	-0,62 %	0,93 %
AKH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-4,28 %	-0,65 %	-1,14 %	-0,62 %	1,45 %
ANH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-3,28 %	-0,65 %	-0,78 %	-0,62 %	1,75 %
AUH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-3,12 %	-0,65 %	-0,69 %	-0,62 %	2,47 %
DE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-5,27 %	-0,65 %	-1,88 %	-0,62 %	0,67 %
IE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-4,13 %	-0,65 %	-0,70 %	-0,62 %	1,89 %
IEP	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-4,14 %	-0,65 %	-0,76 %	-0,62 %	1,68 %
IGH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-2,61 %	-0,65 %	-0,11 %	-0,62 %	2,38 %
INH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-2,52 %	-0,65 %	-0,09 %	-0,62 %	2,28 %
IU	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-9,97 %	-0,65 %	-7,81 %	-0,62 %	11,08 %
IUH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-2,48 %	-0,65 %	-0,05 %	-0,62 %	3,16 %
JE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-4,06 %	-0,65 %	-0,73 %	-0,62 %	1,69 %
JGH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-2,57 %	-0,65 %	-0,01 %	-0,62 %	2,33 %
JUH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-2,42 %	-0,65 %	0,01 %	-0,62 %	2,97 %
LE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-3,99 %	-0,65 %	-0,57 %	-0,62 %	2,04 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities								
<i>(Fortsetzung)</i>								
LEP	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-3,82 %	-0,65 %	-0,56 %	-0,62 %	2,04 %
LGH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-2,28 %	-0,65 %	0,12 %	-0,62 %	2,48 %
XE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat	Wertentwicklung seit Auflegung am 8. April 2020	-0,11 %	-3,77 %	-0,65 %	-0,30 %	-0,46 %	7,21 %
XGH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-2,25 %	-0,65 %	0,22 %	-0,62 %	2,79 %
XUH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat	Wertentwicklung seit Auflegung am 8. April 2020	-0,11 %	-2,04 %	-0,65 %	0,51 %	-0,46 %	7,83 %
YE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-4,24 %	-0,65 %	-0,87 %	-0,62 %	1,63 %
YGH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-2,74 %	-0,65 %	-0,24 %	-0,62 %	2,17 %
YUH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-2,58 %	-0,65 %	-0,21 %	-0,62 %	2,82 %
ZE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-4,35 %	-0,65 %	-0,94 %	-0,62 %	1,69 %
ZFH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-4,77 %	-0,65 %	-1,13 %	-0,62 %	1,39 %
ZGH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-2,83 %	-0,65 %	-0,31 %	-0,62 %	2,23 %
ZUH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,11 %	-2,59 %	-0,65 %	-0,24 %	-0,62 %	2,94 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha								
AE	EURIBOR 3M		0,34 %	-8,70 %	-0,55 %	7,41 %	-0,43 %	-0,45 %
AEP	EURIBOR 3M		0,34 %	-8,70 %	-0,55 %	6,49 %	-0,43 %	0,16 %
AUH	EURIBOR 3M		0,34 %	-6,21 %	-0,55 %	7,97 %	-0,43 %	1,39 %
DE	EURIBOR 3M		0,34 %	-9,16 %	-0,55 %	6,00 %	-0,43 %	-0,40 %
IE	EURIBOR 3M		0,34 %	-7,88 %	-0,55 %	6,83 %	-0,43 %	0,93 %
IGH	EURIBOR 3M		0,34 %	-6,62 %	-0,55 %	7,42 %	-0,43 %	1,29 %
LE	EURIBOR 3M		0,34 %	-7,53 %	-0,55 %	7,00 %	-0,43 %	1,58 %
XGH	EURIBOR 3M		0,34 %	-5,92 %	-0,55 %	9,16 %	-0,43 %	2,22 %
ZE	EURIBOR 3M		0,34 %	-7,97 %	-0,55 %	7,37 %	-0,43 %	0,83 %
ZF	EURIBOR 3M		0,34 %	-12,42 %	-0,55 %	3,39 %	-0,43 %	0,62 %
ZFH	EURIBOR 3M		0,34 %	-8,19 %	-0,55 %	6,53 %	-0,43 %	0,43 %
ZGH	EURIBOR 3M		0,34 %	-6,84 %	-0,55 %	8,94 %	-0,43 %	1,31 %
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha								
AEH	S&P 500		-18,11 %	-29,77 %	28,71 %	23,64 %	18,40 %	21,51 %
AU	S&P 500		-18,11 %	-27,31 %	28,71 %	24,80 %	18,40 %	23,40 %
DEH	S&P 500		-18,11 %	-30,13 %	28,71 %	22,95 %	18,40 %	20,92 %
DU	S&P 500		-18,11 %	-27,67 %	28,71 %	24,18 %	18,40 %	22,78 %
IU	S&P 500		-18,11 %	-26,65 %	28,71 %	25,93 %	18,40 %	24,50 %
ZU	S&P 500		-18,11 %	-26,83 %	28,71 %	25,84 %	18,40 %	24,34 %
1E	S&P 500		-18,11 %	-22,46 %	28,71 %	34,43 %	18,40 %	13,32 %
1EH	S&P 500		-18,11 %	-29,71 %	28,71 %	23,74 %	18,40 %	21,57 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2022		31. Dezember 2021		31. Dezember 2020	
			Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite	Benchmark	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha								
<i>(Fortsetzung)</i>								
1U	S&P 500		-18,11 %	-27,23 %	28,71 %	24,94 %	18,40 %	23,52 %
2E	S&P 500		-18,11 %	-21,79 %	28,71 %	35,61 %	18,40 %	14,30 %
2U	S&P 500		-18,11 %	-26,61 %	28,71 %	26,14 %	18,40 %	24,65 %
3U	S&P 500		-18,11 %	-26,68 %	28,71 %	25,88 %	18,40 %	24,45 %
8E	S&P 500		-18,11 %	-21,82 %	28,71 %	35,53 %	18,40 %	14,25 %
8U	S&P 500		-18,11 %	-26,63 %	28,71 %	25,97 %	18,40 %	24,53 %
9U	S&P 500		-18,11 %	-26,62 %	28,71 %	26,03 %	18,40 %	24,48 %
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha								
AEH	MSCI AC World		-17,96 %	-28,37 %	19,04 %	7,85 %	16,82 %	21,19 %
AU	MSCI AC World		-17,96 %	-25,81 %	19,04 %	9,02 %	16,82 %	23,11 %
DEH	MSCI AC World		-17,96 %	-28,87 %	19,04 %	7,35 %	16,82 %	20,47 %
DU	MSCI AC World		-17,96 %	-26,18 %	19,04 %	8,48 %	16,82 %	22,56 %
IU	MSCI AC World		-17,96 %	-25,14 %	19,04 %	10,00 %	16,82 %	24,22 %
ZU	MSCI AC World		-17,96 %	-25,28 %	19,04 %	9,92 %	16,82 %	24,08 %
1E	MSCI AC World		-17,96 %	-20,86 %	19,04 %	17,43 %	16,82 %	13,07 %
1U	MSCI AC World		-17,96 %	-25,73 %	19,04 %	9,14 %	16,82 %	23,25 %
2E	MSCI AC World		-17,96 %	-20,18 %	19,04 %	18,52 %	16,82 %	14,04 %
2U	MSCI AC World		-17,96 %	-25,09 %	19,04 %	10,08 %	16,82 %	24,31 %
8E	MSCI AC World		-17,96 %	-20,21 %	19,04 %	18,39 %	16,82 %	13,99 %
8U	MSCI AC World		-17,96 %	-25,12 %	19,04 %	10,04 %	16,82 %	24,26 %
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities								
AEH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	14,13 %	27,11 %	22,67 %	-3,12 %	-3,93 %
AFH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	13,46 %	27,11 %	22,48 %	-3,12 %	-4,10 %
AGH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	15,29 %	27,11 %	23,16 %	-3,12 %	-3,80 %
ASH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	16,09 %	27,11 %	23,70 %	-3,12 %	-3,11 %
AU	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	16,83 %	27,11 %	24,03 %	-3,12 %	-2,37 %
DEH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	13,85 %	27,11 %	22,07 %	-3,12 %	-4,41 %
DU	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	16,54 %	27,11 %	23,44 %	-3,12 %	-2,85 %
IEH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	14,46 %	27,11 %	23,89 %	-3,12 %	-2,91 %
IG	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	31,81 %	27,11 %	26,34 %	-3,12 %	-4,55 %
IGH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	15,64 %	27,11 %	24,40 %	-3,12 %	-2,79 %
IU	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	17,18 %	27,11 %	25,26 %	-3,12 %	-1,34 %
NG	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	32,40 %	27,11 %	26,86 %	-3,12 %	-4,05 %
XU	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	18,12 %	27,11 %	26,32 %	-3,12 %	-0,49 %
ZEH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	14,45 %	27,11 %	23,83 %	-3,12 %	-2,96 %
ZFH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	13,72 %	27,11 %	23,58 %	-3,12 %	-3,15 %
ZGH	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	15,60 %	27,11 %	24,31 %	-3,12 %	-2,85 %
ZU	Bloomberg Commodity Index		16,09 %	17,14 %	27,11 %	25,19 %	-3,12 %	-1,38 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2022 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)

Die Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transaction Regulation, „SFTR“) führt Meldepflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFTs“) und Total Return Swaps ein. Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft ist gemäß der Definition in Artikel 3(11) der SFTR Folgendes:

- ein Pensionsgeschäft/umgekehrtes Pensionsgeschäft;
- ein Wertpapier- oder Warenverleihgeschäft und ein Wertpapier- oder Warenentleihgeschäft;
- ein Kauf-/Rückverkaufgeschäft oder ein Verkauf-/Rückkaufgeschäft; oder
- ein Lombardgeschäft.

Zum 31. März 2023 hielt die SICAV Total Return Swaps („TRS“) als eine Art von Instrumenten, die in den Geltungsbereich der SFTR fallen.

Weltweite Daten

Name des Portfolios	Art des Vermögenswerts	Nicht realisierter Gewinn und Verlust in der Portfolio-Basiswährung und als absoluter Wert	% des Nettovermögens
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	TRS	263.301	1,34
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	TRS	1.838.347	2,36
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	TRS	570.509	0,64
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	TRS	1.632.152	2,01
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	TRS	2.142.039	1,07

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten

Im Berichtsjahr zum 31. März 2023 wurden keine Sicherheiten wiederverwendet.

Konzentrationsdaten

Bei allen zum 31. März 2023 für TRS erhaltenen Sicherheiten handelt es sich um Barmittel. Die Angabe der zehn größten Emittenten ist daher nicht möglich.

Die folgende Tabelle bietet Details zu den zehn wichtigsten Kontrahenten (auf Basis des Bruttovolumens ausstehender Transaktionen) in Bezug auf TRS, die zum 31. März 2023 vom Portfolio gehalten wurden:

Name des Portfolios	Art des Vermögenswerts	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn und Verlust in der Portfolio-Basiswährung und als absoluter Wert
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	TRS	UBS	221.525
		Bank of America Merrill Lynch	41.776
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	TRS	UBS	1.817.025
		Goldman Sachs	21.322
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	TRS	UBS	549.776
		Bank of America Merrill Lynch	20.733
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	TRS	UBS	1.632.152
		Goldman Sachs	1.086.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	TRS	Macquarie	532.045
		JPMorgan	523.994

Verwahrung erhaltener Sicherheiten

Barsicherheiten werden im Geldkonto des jeweiligen Portfolios bei der Citibank Europe plc, Niederlassung Luxemburg, gehalten.

Die folgende Tabelle zeigt die von der SICAV zum 31. März 2023 gehaltenen Termineinlagen:

Name des Portfolios	Art der Sicherheit	Kontrahent	Währung der Sicherheit	Betrag der Sicherheit
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Barmittel	UBS	EUR	530.000
		Gesamt	EUR	530.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Barmittel	Bank of America Merrill Lynch	USD	50.000
		Gesamt	USD	50.000
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Barmittel	UBS	USD	830.000
		Gesamt	USD	830.000

Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Name des Portfolios	Art der Sicherheit	Kontrahent	Währung der Sicherheit	Betrag der Sicherheit
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Barmittel	Goldman Sachs	USD	1.920.000
		Macquarie	USD	1.070.000
		JPMorgan	USD	2.750.000*
		Gesamt	USD	5.740.000

*Diese Sicherheiten beziehen sich möglicherweise auf andere Transaktionen als TRS, die nicht unter die Offenlegung gemäß SFT-Verordnung fallen.

Transaktionsdaten insgesamt

Name des Portfolios	Art der Sicherheit	Laufzeit (Sicherheit)	Währung der Sicherheit	Laufzeit (SFT/TRS)	Land der Niederlassung (Kontrahent)	Abwicklung und Clearing	Qualität der Sicherheit
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Barmittel	Restlaufzeit	USD	1 Tag bis 1 Monat / 1 Monat bis 3 Monate	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Barmittel	Restlaufzeit	EUR	3 Monate bis 1 Jahr / mehr als 1 Jahr	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Barmittel	Restlaufzeit	USD	1 Tag bis 1 Monat / 1 Monat bis 3 Monate	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Barmittel	Restlaufzeit	USD	mehr als 1 Jahr	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Barmittel	Restlaufzeit	USD	1 Tag bis 1 Monat	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel

Verwahrung gewährter Sicherheiten

An die Kontrahenten gezahlte Barmittel und Sicherheiten werden auf separate Konten beim Kontrahenten eingezahlt.

Der Betrag der für TRS gewährten Sicherheiten zum 31. März 2023 ist wie folgt:

Name des Portfolios	Art der Sicherheit	Kontrahent	Währung der Sicherheit	Betrag der Sicherheit	% der zum Ende des Geschäftsjahres gehaltenen Sicherheiten nach Kategorie
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Barmittel	UBS	USD	170.000	0,87
		Gesamt	USD	170.000	0,87
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Barmittel	UBS	USD	450.000	0,51
		Gesamt	USD	450.000	0,51

Rendite/Kosten

Die Rendite und die Kosten von TRS-Transaktionen zum 31. März 2023 werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens des jeweiligen Portfolios unter der Überschrift „Zinsaufwand aus Swaps“, „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swaps“ und „Änderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Swaps“ ausgewiesen.

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: Threadneedle (Lux) European High Yield Bond Fund

Rechtsträgerkennung (LEI, Legal Entity Identifier): 54930067E3IWWWEY1X181

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Mit diesem Finanzprodukt wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt**: ___ %

In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind

In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind

Mit dem Finanzprodukt wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___ %

Nein

Das Finanzprodukt **bewarb ökologische und soziale Merkmale** und Obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt das Finanzprodukt ___ % an nachhaltigen Investitionen

Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind

Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind

Mit einem sozialen Ziel

Mit dem Finanzprodukt wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Kapitalanlage in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines 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 in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel können taxonomiekonform sein oder auch nicht.



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

Das Finanzprodukt bewirbt ökologische und soziale Merkmale, indem es die folgenden Maßnahmen eines verantwortungsbewussten Investments in den Entscheidungsprozess für Kapitalanlagen beinhaltet:

- Übertreffen des Verzeichnisses grundlegender ESG-Kriterien, gemessen anhand des Modells „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ über rollierende 12-monatige Zeiträume

Anhand von **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden.

- Beibehaltung von mindestens 50 % an Portfoliobeständen an Unternehmen, die ein Rating von 1 bis 3 beim „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ aufweisen. Bei Notwendigkeit durch Bewertung von Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder durch Zusammenarbeit mit Unternehmen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird.
- Ausschluss von Emittenten, die gegen anerkannte internationale Standards und Prinzipien wie den „United Nations Global Compact“ (Global Pakt der Vereinten Nationen) und die „United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights“ (UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte) verstoßen
- Ausschluss von Emittenten, die gemäß der „Columbia Threadneedle Controversial Weapons Policy“ an kontroversen Waffen beteiligt sind, und von Emittenten mit direkter Beteiligung an Atomwaffen
- Zur Unterstützung der Bewertung von ökologischen und sozialen Merkmalen gehen wir auf Unternehmen zu und wirken bei den Managementteams auf die Verbesserung hin, zum Beispiel bei Fragen im Zusammenhang mit CO₂-Emissionen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Das Finanzprodukt weist folgende Nachhaltigkeitsindikatoren auf:

- Der primäre Indikator ist das positive gewichtete durchschnittliche „ESG Materiality Rating“ des Portfolios gegenüber dem „ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained Index“, bewertet über rollierende 12-monatige Zeiträume. Das positive „ESG Materiality Rating“ gegenüber dem Index wurde täglich von unseren Compliance-Systemen überwacht. Das Portfolio wies während des Berichtszeitraums ein besseres „ESG Materiality Rating“ auf als die Benchmark. Am 31. März 2023 lag das Rating des Portfolios bei 2,51 und das Benchmarkrating bei 2,74 (auf einer Skala von 1 bis 5, je niedriger, desto besser).
- Wir investierten mindestens 50 % des Portfolios in Unternehmen mit einem starken „ESG Materiality Rating“. Bei Notwendigkeit bewerten wir Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder wir arbeiten mit Unternehmen zusammen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird. Das Finanzprodukt behielt im Berichtszeitraum seine Beteiligungen von über 50 % an Emittenten mit einem Rating von 1 bis 3 bei.
- Wir schlossen Unternehmen aus, die unserer Ansicht nach gegen anerkannte internationale Standards verstoßen haben, zum Beispiel gegen die „UN Global Compact Principals“. Die Einhaltung der Ausschlusspolitik wurde durch die Anwendung strenger Verhandelsbeschränkungen gewährleistet und kontinuierlich überwacht.
- Zudem hielten wir die „Controversial Weapons Policy“ ein und schlossen Emittenten mit direkter Beteiligung an Atomwaffen aus.

Da diese Indikatoren die Grundlage für die vom Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bilden, sind die Indikatoren auch die verbindlichen Elemente der ESG-Strategie des Portfolios.

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

Eine Gegenüberstellung der Nachhaltigkeitsindikatoren zu einem vergangenen Zeitraum werden wir im nächsten Bericht vorlegen.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den „OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen“ und den „UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte“ in Einklang? Nähere Angaben:

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

In der EU-Taxonomie ist das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ 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.

Auch alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele nicht erheblich beeinträchtigen.

Bei den wesentlichen 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 wesentlichsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.



Was waren die wesentlichen Investitionen bei diesem Finanzprodukt?

Name des Emittenten	Durchschnittliche Gewichtung	Wirtschaftszweig	Land
Ford	2,87 %	Automobile	Vereinigte Staaten
Electricite de France	2,64 %	Versorgungsunternehmen	Frankreich
Telefonica	2,36 %	Telekommunikation	Spanien
Telecom Italia	2,08 %	Telekommunikation	Italien
Cellnex	1,99 %	Telekommunikation	Spanien
Virgin Media	1,88 %	Telekommunikation	Vereinigtes Königreich
SFR	1,86 %	Telekommunikation	Frankreich
Vodafone	1,85 %	Telekommunikation	Vereinigtes Königreich
Iliad	1,83 %	Telekommunikation	Frankreich
Faurecia	1,77 %	Automobile	Frankreich
Deutsche Lufthansa	1,75 %	Transport	Deutschland
Repsol	1,50 %	Energie	Spanien
Iqvia	1,46 %	Gesundheitswesen	Vereinigte Staaten
Teva	1,40 %	Pharmazeutik	Israel
Autostrade per L'Italia	1,33 %	Transport	Italien

Die Liste umfasst diejenigen Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden; diese sind:



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

54,92 % des Finanzprodukts waren in Emittenten mit einem „ESG Materiality Rating“ von 1 bis 3 investiert und somit auf ökologische/soziale Merkmale ausgerichtet.

45,08 % des Finanzprodukts waren investiert in: (1) Emittenten mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, die daher nicht mit ökologischen/sozialen Merkmalen in Einklang standen, (2) Emittenten, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen, und (3) Barmittel und Derivate.



#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 wurden.

● *In welchen Wirtschaftszweigen wurden die Investitionen getätigt?*

Wirtschaftszweig	Durchschnittliche Gewichtung
Telekommunikation	16,05 %
Kraftfahrzeuge	11,21 %
Dienstleistungen	7,94 %
Gesundheitswesen	7,90 %
Grundstoffindustrie	6,56 %
Freizeit	5,91 %
Versorgungsunternehmen	5,14 %
Transport	4,81 %
Finanzdienstleistungen	4,42 %
Medien	3,91 %
Einzelhandel	3,59 %
Banken	3,48 %
Investitionsgüter	3,45 %
Energie	3,34 %
Immobilien	2,84 %
Technologie und Elektronik	2,43 %
Konsumgüter	1,98 %

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

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

Ermöglichende Tätigkeiten ermöglichen unmittelbar, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel leisten.

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



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

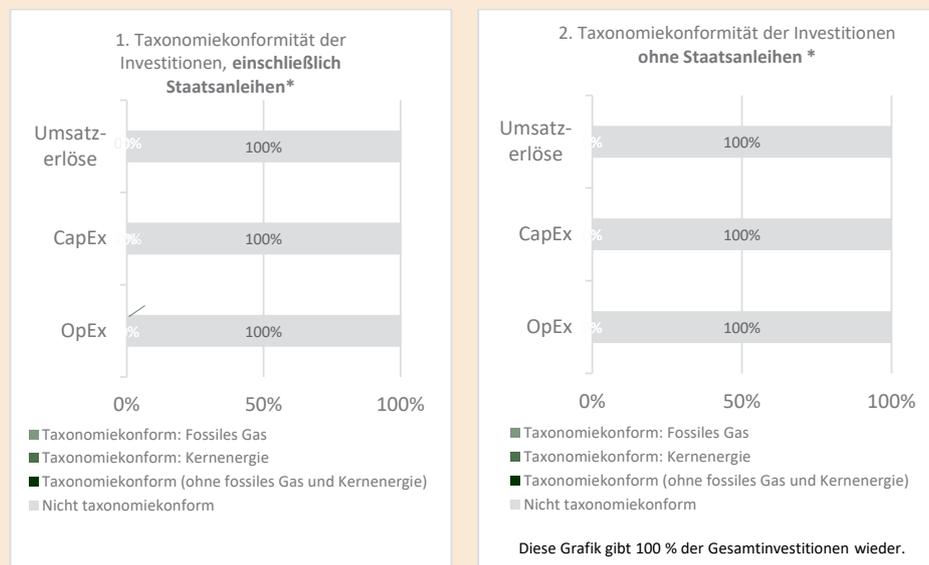
Der Fonds ist nicht verpflichtet, die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung zu erfüllen.

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in mit der EU-Taxonomie konforme Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ investiert¹?



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



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

¹ Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ sind nur dann mit der EU-Taxonomie konform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links. Die vollständigen Kriterien für mit der EU-Taxonomie konforme Wirtschaftstätigkeiten in den Bereichen „Fossiles Gas“ und „Kernenergie“ sind der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission zu entnehmen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?**

0 % der vom Fonds getätigten Kapitalanlagen befinden sich in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung.

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

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden. Der Fonds hat noch keine Angleichung an die EU-Taxonomieverordnung gemeldet.

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

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren, deren Umweltziel nicht mit der EU-Taxonomieverordnung im Einklang steht.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel zu investieren.

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

Zu den als „Andere“ eingestuften Beteiligungen gehören (i) zusätzliche liquide Mittel (d. h. Sichteinlagen bei einer Bank), die zum Zwecke des Liquiditätsmanagements gehalten werden, (ii) Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente oder Geldmarktfonds, die zu steuerlichen Zwecken gehalten werden, oder (iii) Derivate zu Absicherungszwecken, (iv) Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, oder (v) Unternehmen, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen.

Diese Investitionen werden nicht zum Erfüllen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios genutzt. Der Zweck dieser Wertpapiere besteht darin, ein diversifiziertes Portfolio zu erreichen, das die finanzielle Zielstellung erreichen kann.

Mindestschutz zu Umwelt oder Sozialem wird durch Ausschluss-Screening aller Beteiligungen an Unternehmen, in die investiert wird, gewährleistet. Bei Barpositionen und Derivaten sind ESG-Erwägungen in die Bewertung des Kontrahentenrisikos integriert.

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



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

Wir führten Gespräche mit Unternehmen, mit dem Ziel, ihre Herangehensweise in Bezug auf ESG-Risiken und ESG-Praktiken zu beeinflussen. Wir haben uns beispielsweise im Berichtszeitraum mit dem Automobilunternehmen Ford in Verbindung gesetzt und die Themen Klimastrategie, Lieferketten und Rohstoffbeschaffung besprochen. Das Unternehmen war offen für unser Feedback, und wir regten zu ehrgeizigeren Zielen bei der Reduzierung der CO₂-Emissionen Scope 3 und bei der Berichterstattung zur EU-Taxonomie als Schlüsselbereiche für Verbesserungen an und betonten die Wichtigkeit des Strebens nach besseren ESG-Ratings durch Dritte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie unterscheidet sich die Referenzbenchmark von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **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?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

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

Während des Berichtszeitraums wies das Finanzprodukt ein hervorragendes ESG-Profil gegenüber dem „ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained Index“ auf, gemessen am Modell „Columbia Threadneedle Investments ESG Materiality Rating“.

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: Threadneedle (Lux) European Social Bond

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300071NVI9LFDKW96

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Nein
<input type="checkbox"/> Mit diesem Finanzprodukt wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___ %	<input type="checkbox"/> Das Finanzprodukt bewarb ökologische und soziale Merkmale und Obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt das Finanzprodukt ___ % an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind	<input type="checkbox"/> Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind
<input type="checkbox"/> In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind	<input type="checkbox"/> Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___ %	<input type="checkbox"/> Mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/> Mit dem Finanzprodukt wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

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

Das Finanzprodukt bewirbt soziale Merkmale, indem es die folgenden Maßnahmen eines verantwortungsbewussten Investments in den Entscheidungsprozess für Kapitalanlagen beinhaltet:

- Investitionen in Schuldtitel, bei denen davon ausgegangen wird, dass sie sozial vorteilhafte Tätigkeiten und Entwicklungen fördern oder finanzieren.
- Ausgeschlossen sind Emittenten, die unserer Meinung nach gegen anerkannte internationale Standards und Governance-Grundsätze verstoßen.



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 in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das 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.

Anhand von **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden.

- Ausgeschlossen sind Emittenten, die Erträge aus Branchen oder Aktivitäten erzielen, die über bestimmten Schwellenwerten liegen (z. B. Tabak, Alkohol, Erwachsenenunterhaltung und Glücksspiel, Kraftwerkskohle und/oder Atomwaffen und/oder konventionelle Waffen).

Alle im Portfolio gehaltenen Anleihen erfüllten im Berichtszeitraum die oben genannten Kriterien.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Das Portfolio weist folgende Nachhaltigkeitsindikatoren auf:

- Investitionen in Schuldtitel, die sozial vorteilhafte Tätigkeiten und Entwicklungen unterstützen oder finanzieren, bewertet anhand unserer „Social Rating Methodology“. Im Rahmen dieser Methode wird jede einzelne Kapitalanlage mittels eines zweigleisigen Verfahrens analysiert. Dieses Verfahren führt Folgendes aus:
 - Bewertung der sozialen Intentionalität, die mit der Verwendung der Erlöse einer Anleihe verbunden ist, und Kategorisierung als „Wirksame Investition“, als „Investition mit Wirkungen“ oder als „Entwicklungsfinanzierung“. Andernfalls wird die Kapitalanlage als allgemeine Finanzierung eingestuft und fällt nicht in den Bereich eines für eine Kapitalanlage zulässigen sozialen Universums.
 - Bewertung der allgemeinen sozialen Wirkungsstärke anhand eines dreistufigen Modells. Das Modell untersucht neun Eigenschaften der sozialen Ergebnisse, die einer Anleihe zuzuschreiben sind, und berechnet einen numerischen Score von bis zu „31“. Damit eine Anleihe als geeignet angesehen werden kann, ist ein Score von mindestens „5“ erforderlich. Anleihen mit einem geeigneten numerischen Score werden in Quartile der sozialen Wirkungsstärke von „geringfügig“, „moderat“, „gut“ oder „stark“ (1 bis 4) unterteilt. Zwar werden keine formalen Ziele für den Fonds festgelegt, jedoch besteht das Ziel darin, die sozialen Auswirkungen zu maximieren. Dies lässt sich durch die durchschnittliche soziale Bewertung des Portfolios im Laufe der Zeit beobachten.

Insgesamt generiert der Prozess einen diskreten sozialen Score (A1 bis C4). Anhand dieses Scores werden Anleihen miteinander verglichen, die unterschiedliche soziale Bedürfnisse erfüllen, und der Grad der sozialen Wirksamkeit des Portfolios im Laufe der Zeit wird überwacht.

Ergebnisse des sozialen Ratings, in % des Portfolios

	1 - Stark	2 - Gut	3 - Mäßig	4 - Gering
A	37,0 %	1,9 %	–	–
B	6,3 %	17,6 %	13,8 %	0,7 %
C	7,0 %	4,0 %	5,5 %	5,1 %

Der Sozialpartner des Fonds erstellt einen jährlichen Bericht über die sozialen Auswirkungen. Der Bericht enthält eine Bewertung der vom Fonds beworbenen sozialen Merkmale.

Im Rahmen der Unterstützung des Fonds bei der positiven Bewertung von sozialen Ergebnissen und Wirkungsmerkmalen hielt der Fonds an folgenden Punkten fest:

- Ausschluss von Emittenten, die Erträge aus Branchen oder Tätigkeiten erzielen, die über bestimmten Schwellenwerten liegen, wenn diese Branchen, Tätigkeiten oder Emittenten nur minimalen Nutzen für Soziales oder Nachhaltigkeit bieten oder ein hohes Risiko nachteiliger Auswirkungen darstellen.

Ausschlüsse auf der Grundlage von Umsatzschwellenwerten werden kontinuierlich überwacht, um sicherzustellen, dass das Portfolio die Vorgaben erfüllt.

- Ausschluss von Emittenten, die gegen anerkannte internationale Standards und Grundsätze verstoßen, beispielsweise gegen die „UN Global Compact Principals“.

Im Berichtszeitraum wurde die Einhaltung der Ausschlusspolitik durch die Anwendung strenger Vorhandelsbeschränkungen und eine kontinuierliche Überprüfung gewährleistet. Zudem hielten wir die „Controversial Weapons Policy“ ein und investierten nicht in Emittenten mit direkter Beteiligung an Atomwaffen.

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

Eine Gegenüberstellung der Nachhaltigkeitsindikatoren zu einem vergangenen Zeitraum werden wir im nächsten Bericht vorlegen.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen im Sinne der Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten zu investieren.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den „OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen“ und den „UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte“ in Einklang? Nähere Angaben:

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Bei den wesentlichen 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?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst diejenigen Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden; diese sind:

Größte Investitionen	Sektor	Durchschnittliche Gewichtung	Land
Credit Agricole	Banken	2,84 %	Frankreich
Europarat	Supranational	2,75 %	Supranational
Wellcome Trust	Finanzdienstleistungen	2,29 %	Vereinigtes Königreich
Europäische Union	Supranational	1,99 %	Supranational
UNEDIC	Behörde	1,88 %	Frankreich
BPCE	Banken	1,65 %	Frankreich
Vonovia	Immobilien	1,64 %	Deutschland
NatWest	Banken	1,62 %	Vereinigtes Königreich
Instituto De Credito Oficial	Behörde	1,56 %	Spanien
International Finance Facility	Supranational	1,52 %	Supranational
Cassa Depositi E Prestiti	Behörde	1,51 %	Italien
E.ON	Versorgungsunternehmen	1,51 %	Deutschland
Caisse Amortissement De La Dette	Behörde	1,49 %	Frankreich
ING	Banken	1,40 %	Niederlande
Orange	Telekommunikation	1,40 %	Frankreich



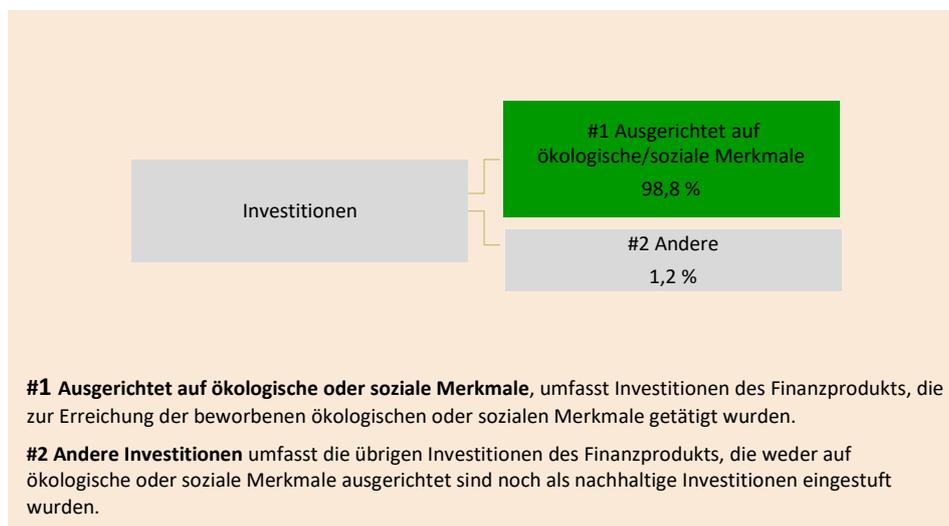
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

98,8 % des Finanzprodukts waren in Schuldtitel investiert. Alle diese Titel unterliegen der „Social Rating Methodology“ und den Ausschlusskriterien.

1,2 % des Finanzprodukts waren in Barmittel oder Barmitteläquivalente investiert.

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



● In welchen Wirtschaftszweigen wurden die Investitionen getätigt?

Sektor	Durchschnittliche Gewichtung
Kommunale Emittenten	26,66 %
Banken	24,81 %
Versorgungsunternehmen	12,73 %
Immobilien	6,13 %
Telekommunikation	5,39 %
Versicherungen	4,55 %
Konsumgüter	3,66 %



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

Der Fonds ist nicht verpflichtet, die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung zu erfüllen.

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden.

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

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.

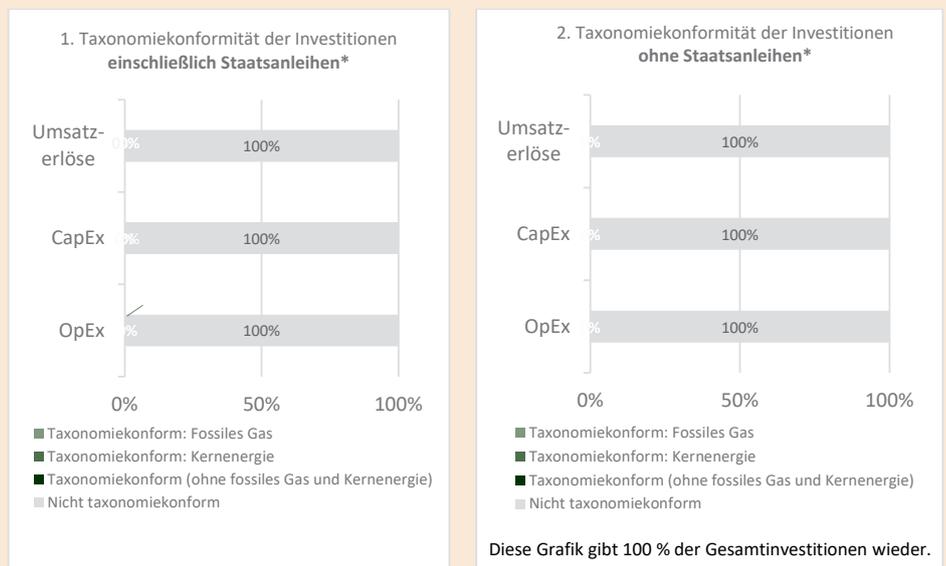
● **Wurde mit dem Finanzprodukt in mit der EU-Taxonomie konforme Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ investiert¹?**

- Ja:
 - In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

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



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

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?**

0 % der vom Fonds getätigten Kapitalanlagen befinden sich in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung.

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

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die

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

gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden. Der Fonds hat noch keine Angleichung an die EU-Taxonomieverordnung gemeldet.



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 nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren, deren Umweltziel nicht mit der EU-Taxonomieverordnung im Einklang steht.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel zu investieren.



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

Zu den als „Andere“ eingestuften Kapitalanlagen gehören (i) zusätzliche liquide Mittel (d. h. Sichteinlagen bei einer Bank), die zum Zwecke des Liquiditätsmanagements gehalten werden, (ii) Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente oder Geldmarktfonds, die zu steuerlichen Zwecken gehalten werden, und (iii) Derivate zu Absicherungszwecken.

Diese Investitionen werden nicht zum Erfüllen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios genutzt.

Mindestschutz zu Umwelt oder Sozialem für Barpositionen und Derivate sind durch Einbeziehung in die Bewertung des ESG-Kontrahentenrisikos integriert.



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

Als Anleiheinhaber suchen wir aktiv nach Gelegenheiten, mit Emittenten in Kontakt zu treten, um deren sozialen Wert besser zu verstehen und positiv zu beeinflussen. Darüber hinaus arbeiten wir mit Emittenten zusammen, um den Markt in Richtung einer ganz bestimmten Verwendung der ausgeschütteten Erträge zu bringen. Dazu gehören auch das Vorweisen von bewährten Verfahren, Anleihenstruktur und Berichterstattung zu Auswirkungen.

Wir möchten sicherstellen, dass die negativen sozialen Auswirkungen des Übergangs minimiert werden, und versuchen, diesen Herausforderungen durch aktives Engagement mit Emittenten zu diesem Thema entgegenzutreten, um ein integratives Wachstum zu fördern.

Im Rahmen der Förderung der sozialen Merkmale, auf die sich das Produkt bezieht, wurden im Berichtszeitraum auch Themen zu Klimawandel, Umweltstandards, Menschenrechte, Arbeitsstandards und Corporate Governance behandelt. Ein Beispiel für die Zusammenarbeit mit einem Emittenten ist das portugiesische Versorgungsunternehmen EDP. Wir haben im Mai 2022 mit EDP Gespräche bezüglich ihrer aktuellen Emission von Green Bonds und ihrer Überlegungen zum Übergang geführt. Wir diskutierten über künftige Emissionen und mögliche Strukturen. EDP erwägt eine nachhaltigkeitsbezogene Anleihe (SLB). Wir haben klargestellt, dass wir die spezifische Verwendung der Erlöse gegenüber einer SLB bevorzugen. Gründe dafür sind größere Additionalität und Intentionalität sowie typischerweise weniger herausfordernde Ziele in Bezug auf Leistungsindikatoren. Wir schlugen vor, die Leistungsindikatoren in eine Struktur für Nachhaltigkeit/grüne Anleihen einzubetten und die Anwendung von sozialen Leistungsindikatoren zu erwägen. EDP wurde davon überzeugt, die spezifische Verwendung der Emissionserlöse fortzusetzen, und seit unserem Treffen haben wir ihre neue Emission an grünen Anleihen übernommen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt nutzt keine festgelegte Referenzbenchmark, um zu messen, ob das Finanzprodukt die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie unterscheidet sich die Referenzbenchmark von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **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?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

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

Nicht zutreffend – der Marktindex wird nur zum Vergleich von Kapitalrenditen verwendet.

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: Threadneedle (Lux) Emerging Market ESG Equities

Rechtsträgerkennung (LEI, Legal Entity Identifier): 5493003JWKERJYXOI785

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Mit diesem Finanzprodukt wurden 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 qualifiziert sind <input type="checkbox"/> In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind 	<input type="checkbox"/> Das Finanzprodukt bewarb ökologische und soziale Merkmale und Obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt das Finanzprodukt ___ % 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 qualifiziert sind <input type="checkbox"/> Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind <input type="checkbox"/> Mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Mit dem Finanzprodukt wurden nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___ %	<input checked="" type="checkbox"/> Mit dem Finanzprodukt wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

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

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



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

Das Finanzprodukt bewirbt ökologische und soziale Merkmale, indem es die folgenden Maßnahmen eines verantwortungsbewussten Investments in den Entscheidungsprozess für Kapitalanlagen beinhaltet:

- Übertreffen des Verzeichnisses grundlegender ESG-Kriterien, gemessen anhand des Modells „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ über rollierende 12-monatige Zeiträume

Anhand von **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden.

- Wir investierten mindestens 80 % des Portfolios in Unternehmen mit starken oder sich verbessernden ESG-Merkmalen, gemessen anhand einer Kombination aus Rating „ESG Materiality“ und Fundamentaldatenanalyse der Unternehmen im Portfolio. Im Portfolio werden tendenziell Unternehmen bevorzugt, die im „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ eine hohe Punktzahl erreichen, sodass das Portfolio im Vergleich zum „MSCI Europe Index“ über rollierende 12-monatige Zeiträume eine positive Entwicklung zugunsten von ESG-Merkmalen aufweist. Alle Unternehmen mit hohem Rating werden als mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen/sozialen Merkmalen konform angesehen. Das Portfolio investiert jedoch möglicherweise auch in Unternehmen mit einem schlechteren Rating, und diese Unternehmen werden ebenfalls als an den vom Portfolio beworbenen ökologischen/sozialen Merkmalen konform angesehen, da diese Wertpapiere ungeachtet eines solchen Ratings (i) anhand der Fundamentalanalyse des Unterberaters als Unternehmen bewertet werden, die bereits starke ESG-Praktiken aufweisen, oder (ii) Verbesserungen bei ihren ESG-Praktiken in Betracht ziehen. Der Unterberater ist bestrebt, solche Verbesserungen durch die Umsetzung der Mitwirkungspolitik zu fördern.
- Ausschluss von Unternehmen, die gegen anerkannte internationale Standards und Prinzipien wie den „United Nations Global Compact“ (Global Pakt der Vereinten Nationen) und die „United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights“ (UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte) verstoßen
- Ausschluss von Unternehmen, die gemäß der „Columbia Threadneedle Controversial Weapons Policy“ an kontroversen Waffen beteiligt sind, und von Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen
- Zur Unterstützung der Bewerbung von ökologischen und sozialen Merkmalen gehen wir auf Unternehmen zu und wirken bei den Managementteams auf die Verbesserung hin, zum Beispiel bei Fragen im Zusammenhang mit CO₂-Emissionen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Das Finanzprodukt weist folgende Nachhaltigkeitsindikatoren auf:

- Der primäre Indikator ist das positive gewichtete durchschnittliche ESG Materiality Rating des Portfolios gegenüber dem MSCI Emerging Markets Index, bewertet über rollierende 12-Monats-Zeiträume. Das positive „ESG Materiality Rating“ gegenüber dem Index wurde täglich von unseren Compliance-Systemen überwacht. Das Portfolio wies während des Berichtszeitraums ein besseres „ESG Materiality Rating“ auf als die Benchmark. Am 31. März 2023 lag das Rating des Portfolios bei 2,00 und das Benchmarkrating bei 2,34 (auf einer Skala von 1 bis 5, je niedriger, desto besser).
- Wir investierten mindestens 80 % des Portfolios in Unternehmen mit starken oder sich verbessernden ESG-Merkmalen, gemessen anhand einer Kombination aus Rating „ESG Materiality“ und Fundamentaldatenanalyse der Unternehmen im Portfolio.
- Wir schlossen Unternehmen aus, die unserer Ansicht nach gegen anerkannte internationale Standards verstoßen haben, zum Beispiel gegen die „UN Global Compact Principals“. Die Einhaltung der Ausschlusspolitik wurde durch die Anwendung strenger Verhandelsbeschränkungen gewährleistet und kontinuierlich überwacht.
- Zudem hielten wir die „Controversial Weapons Policy“ ein und schlossen Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen aus.
Da diese Indikatoren die Grundlage für die vom Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bilden, sind die Indikatoren auch die verbindlichen Elemente der ESG-Strategie des Portfolios.

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

Eine Gegenüberstellung der Nachhaltigkeitsindikatoren zu einem vergangenen Zeitraum werden wir im nächsten Bericht vorlegen.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den „OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen“ und den „UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte“ in Einklang? Nähere Angaben:

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Bei den **wesentlichen 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?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.



Was waren die wesentlichen Investitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst diejenigen Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden.

Größte Investitionen	Wirtschaftszweig	Durchschnittliche Gewichtung	Land
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	Informationstechnologie	7,77 %	Taiwan

TENCENT HOLDINGS LTD	Kommunikationsdienstleistungen	5,73 %	China
SAMSUNG ELECTRONICS LTD	Informationstechnologie	5,56 %	Südkorea
JD.com	Nicht-Basiskonsumgüter	4,77 %	China
MEITUAN	Nicht-Basiskonsumgüter	4,36 %	China
BANK RAKYAT INDONESIA	Finanzen	4,28 %	Indonesien
BANK CENTRAL ASIA	Finanzen	2,90 %	Indonesien
HDFC BANK	Finanzen	2,55 %	Indien
ICICI BANK	Finanzen	2,50 %	Indien
LOCALIZA RENT A CAR	Industriegüter	2,40 %	Brasilien
ITAU UNIBANCO HOLDING	Finanzen	1,95 %	Brasilien
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS	Gesundheitswesen	1,93 %	China
MERCADOLIBRE INC	Nicht-Basiskonsumgüter	1,90 %	Argentinien
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	Gesundheitswesen	1,84 %	Indien
INFOSYS ADR REPRESENTING ONE LTD	Informationstechnologie	1,78 %	Indien



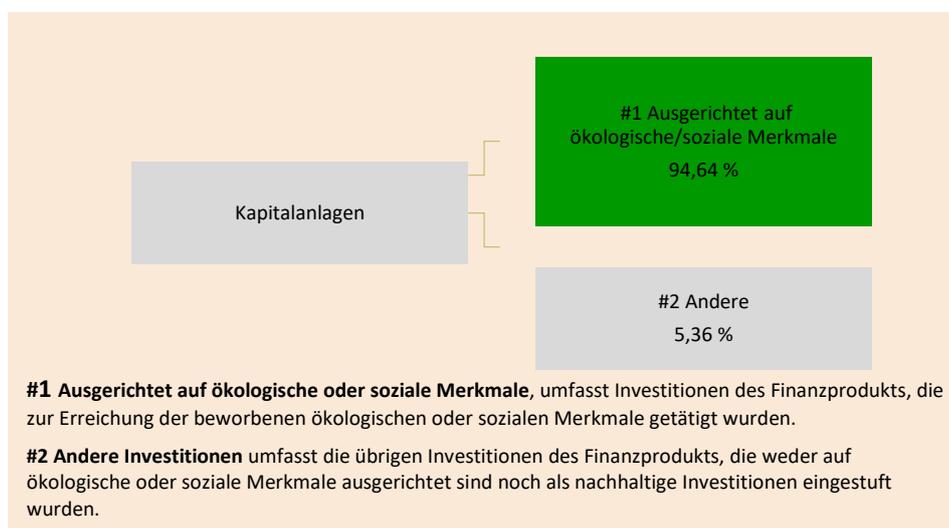
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

94,64 % Wir investierten mindestens 80 % des Portfolios in Unternehmen mit starken oder sich verbessernden ESG-Merkmalen, gemessen anhand einer Kombination aus Rating „ESG Materiality“ und Fundamentaldatenanalyse der Unternehmen im Portfolio.

5,36 % Umfassen die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.

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



● In welchen Wirtschaftszweigen wurden die Investitionen getätigt?

Wirtschaftszweig	Durchschnittliche Gewichtung
Finanzen	30,81 %
Informationstechnologie	24,94 %
Nicht-Basiskonsumgüter	15,73 %
Gesundheitswesen	7,16 %
Kommunikationsdienstleistungen	6,74 %
Industriegüter	5,68 %
Basiskonsumgüter	3,34 %
Energie	1,64 %
Immobilien	0,69 %

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

Ermöglichende Tätigkeiten ermöglichen unmittelbar, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel leisten.

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



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

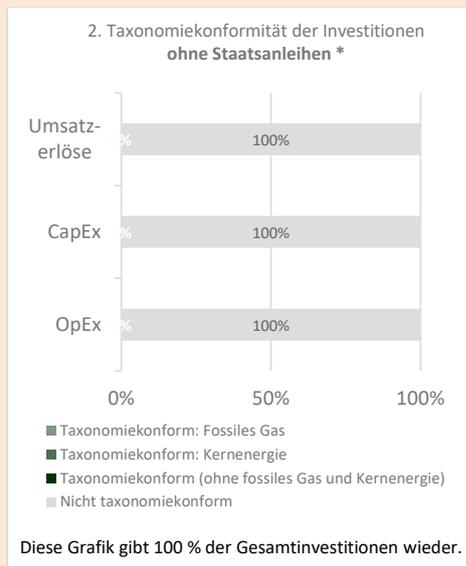
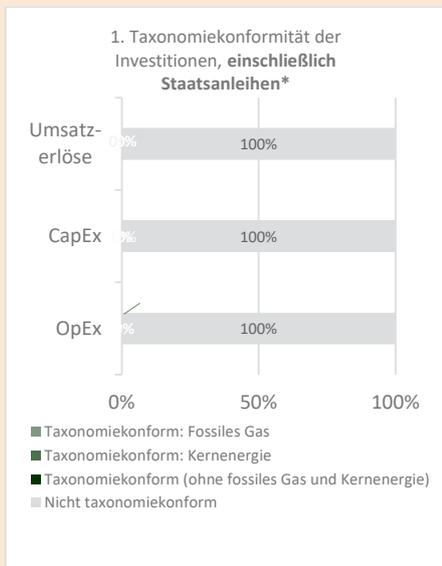
Der Fonds ist nicht verpflichtet, die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung zu erfüllen.

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in mit der EU-Taxonomie konforme Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ investiert¹?**

- Ja:
 - In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

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



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

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?**

0 % der vom Fonds getätigten Kapitalanlagen befinden sich in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung.

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

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

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden. Der Fonds hat noch keine Angleichung an die EU-Taxonomieverordnung gemeldet.



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

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren, deren Umweltziel nicht mit der EU-Taxonomie im Einklang steht.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel zu investieren.



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

Zu den als „Andere“ eingestuften Beteiligungen gehören (i) zusätzliche liquide Mittel (d. h. Sichteinlagen bei einer Bank), die zum Zwecke des Liquiditätsmanagements gehalten werden, (ii) Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente oder Geldmarktfonds, die zu steuerlichen Zwecken gehalten werden, oder (iii) Derivate zu Absicherungszwecken.

Mindestschutz zu Umwelt oder Sozialem für Barpositionen und Derivate sind in die Bewertung des ESG-Kontrahentenrisikos integriert.



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

Wir führten Gespräche mit Unternehmen, mit dem Ziel, ihre Herangehensweise in Bezug auf ESG-Risiken und ESG-Praktiken zu beeinflussen. Im Laufe des Berichtszeitraums haben wir uns beispielsweise Beispiel mit folgenden Unternehmen in Verbindung gesetzt: Mit der Bank Central diskutierten wir die Strategie dieser Bank bezüglich eines nachhaltigen Finanzwesens und einer finanziellen Einbeziehung. Mit der Bank Rakyat Indonesia besprachen wir ein nachhaltiges Finanzwesen, mit Tencent die Wirksamkeit des Boards und verschiedene ESG-Themen. Mit der HDFC Bank diskutierten wir die Wesentlichkeitsumfrage mit Schwerpunkt auf Offenlegung bezüglich des Klimas, und wir erörterten mit WEG Prioritäten in den Bereichen Klima-, Kreislaufwirtschafts- und Arbeitsmanagement.

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie unterscheidet sich die Referenzbenchmark von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **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?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

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

Während des Berichtszeitraums wies das Finanzprodukt ein hervorragendes ESG-Profil gegenüber dem „MSCI Emerging Markets Index“ auf, gemessen am Modell „Columbia Threadneedle Investments Materiality Rating“.

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: Threadneedle (Lux) Global Focus

Rechtsträgerkennung (LEI, Legal Entity Identifier): 549300N6B2IZV18Z4Q40

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt? *[Bitte gegebenenfalls ankreuzen und ausfüllen; der Prozentsatz entspricht den nachhaltigen Investitionen.]*

Ja

Mit diesem Finanzprodukt wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt:** ___ %

In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind

In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind

Mit dem Finanzprodukt wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___ %

Nein

Das Finanzprodukt **bewarb ökologische und soziale Merkmale** und Obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt das Finanzprodukt ___ % an nachhaltigen Investitionen

Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind

Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind

Mit einem sozialen Ziel

Mit dem Finanzprodukt wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Kapitalanlage in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines 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 in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel können taxonomiekonform sein oder auch nicht.



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

Das Finanzprodukt bewirbt ökologische und soziale Merkmale, indem es die folgenden Maßnahmen eines verantwortungsbewussten Investments in den Entscheidungsprozess für Kapitalanlagen beinhaltet:

- Übertreffen des Verzeichnisses grundlegender ESG-Kriterien, gemessen anhand des Modells „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ über rollierende 12-monatige Zeiträume

Anhand von **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden.

- Beibehaltung von mindestens 50 % an Portfoliobeständen an Unternehmen, die ein Rating von 1 bis 3 beim „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ aufweisen. Bei Notwendigkeit durch Bewertung von Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder durch Zusammenarbeit mit Unternehmen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird.
- Ausschluss von Unternehmen, die gegen anerkannte internationale Standards und Prinzipien wie den „United Nations Global Compact“ (Global Pakt der Vereinten Nationen) und die „United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights“ (UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte) verstoßen
- Ausschluss von Unternehmen, die gemäß der „Columbia Threadneedle Controversial Weapons Policy“ an kontroversen Waffen beteiligt sind, und von Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen
- Zur Unterstützung der Bewertung von ökologischen und sozialen Merkmalen gehen wir auf Unternehmen zu und wirken bei den Managementteams auf die Verbesserung hin, zum Beispiel bei Fragen im Zusammenhang mit CO₂-Emissionen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Das Finanzprodukt weist folgende Nachhaltigkeitsindikatoren auf:

- Der primäre Indikator ist das positive gewichtete durchschnittliche „ESG Materiality Rating“ des Portfolios im Vergleich zum „MSCI All Countries World Index“, bewertet über rollierende 12-monatige Zeiträume. Das positive „ESG Materiality Rating“ gegenüber dem Index wurde täglich von unseren Compliance-Systemen überwacht. Das Portfolio wies während des Berichtszeitraums ein besseres „ESG Materiality Rating“ auf als die Benchmark.
Am 31. März 2023 lag das Rating des Portfolios bei 2,44 und das Benchmarkrating bei 2,78 (auf einer Skala von 1 bis 5, je niedriger, desto besser).
- Wir investierten mindestens 50 % des Portfolios in Unternehmen mit einem starken „ESG Materiality Rating“. Bei Notwendigkeit bewerten wir Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder wir arbeiten mit Unternehmen zusammen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird. Das Finanzprodukt behielt im Berichtszeitraum seine Beteiligungen von über 50 % an Unternehmen mit einem Rating von 1 bis 3 bei.
- Wir schlossen Unternehmen aus, die unserer Ansicht nach gegen anerkannte internationale Standards verstoßen haben, zum Beispiel gegen die „UN Global Compact Principals“. Die Einhaltung der Ausschlusspolitik wurde durch die Anwendung strenger Vorhandelsbeschränkungen gewährleistet und kontinuierlich überwacht.
- Zudem hielten wir die „Controversial Weapons Policy“ ein und schlossen Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen aus.

Da diese Indikatoren die Grundlage für die vom Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bilden, sind die Indikatoren auch die verbindlichen Elemente der ESG-Strategie des Portfolios.

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

Eine Gegenüberstellung der Nachhaltigkeitsindikatoren zu einem vergangenen Zeitraum werden wir im nächsten Bericht vorlegen.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den „OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen“ und den „UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte“ in Einklang? Nähere Angaben:

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

In der EU-Taxonomie ist das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ 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.

Auch alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele nicht erheblich beeinträchtigen.

Bei den wesentlichen 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 wesentlichsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.



Was waren die wesentlichen Investitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Wirtschaftszweig	Durchschnittliche Gewichtung	Land
MICROSOFT CORP	Informationstechnologie	7,98 %	Vereinigte Staaten
MASTERCARD INC CLASS A	Finanzen	5,41 %	Vereinigte Staaten
INTUIT INC	Informationstechnologie	4,24 %	Vereinigte Staaten
THERMO FISHER	Gesundheitswesen	3,98 %	Vereinigte Staaten
ALPHABET INC CLASS A	Kommunikationsdienstleistungen	3,98 %	Vereinigte Staaten
LINDE PLC	Roh- und Grundstoffe	3,12 %	Vereinigtes Königreich
LAM RESEARCH CORP	Informationstechnologie	3,06 %	Vereinigte Staaten
KEYENCE CORP	Informationstechnologie	2,56 %	Japan
LONZA GROUP AG	Gesundheitswesen	2,53 %	Schweiz
LVMH	Nicht-Basiskonsumgüter	2,47 %	Frankreich
AMAZON COM INC	Nicht-Basiskonsumgüter	2,34 %	Vereinigte Staaten
CONOCOPHILLIPS	Energie	2,32 %	Vereinigte Staaten
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	Informationstechnologie	2,25 %	Taiwan (Republik China)
ELEVANCE HEALTH INC	Gesundheitswesen	2,24 %	Vereinigte Staaten
RECRUIT HOLDINGS LTD	Industriegüter	2,14 %	Japan

Die Liste umfasst diejenigen Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden.



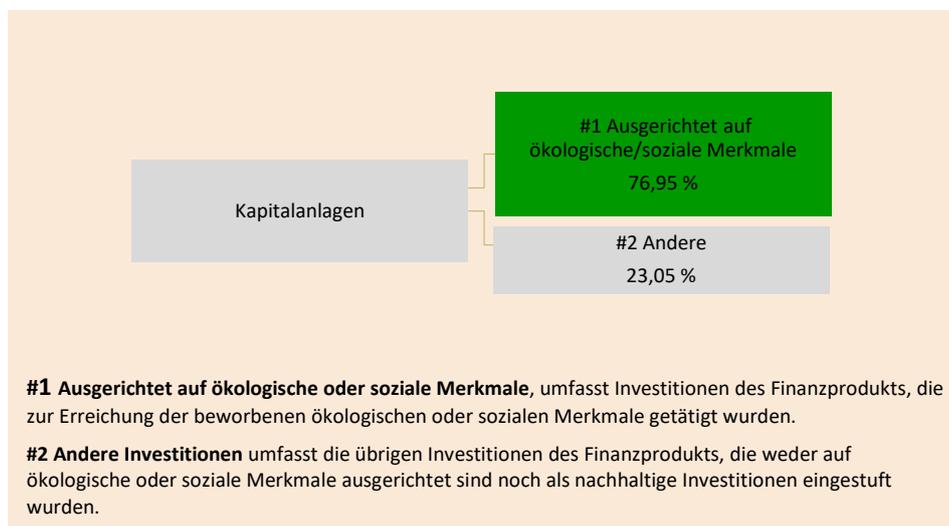
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

76,95 % des Finanzprodukts waren in Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 1 bis 3 investiert und somit auf ökologische/soziale Merkmale ausgerichtet.

23,05 % des Finanzprodukts waren investiert in: (1) Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, die daher nicht mit ökologischen/sozialen Merkmalen in Einklang standen, (2) Unternehmen, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen, und (3) Barmittel und Derivate.

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



● **In welchen Wirtschaftszweigen wurden die Investitionen getätigt?**

Wirtschaftszweig	Durchschnittliche Gewichtung
Informationstechnologie	26,13 %
Gesundheitswesen	17,48 %
Finanzen	15,99 %
Industriegüter	9,51 %
Basiskonsumgüter	8,01 %
Nicht-Basiskonsumgüter	7,08 %
Kommunikationsdienstleistungen	6,21 %
Roh- und Grundstoffe	4,81 %
Energie	2,59 %
Versorgungsunternehmen	0,63 %
Barmittel	1,58 %

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

Ermöglichte Tätigkeiten ermöglichen unmittelbar, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel leisten.

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

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

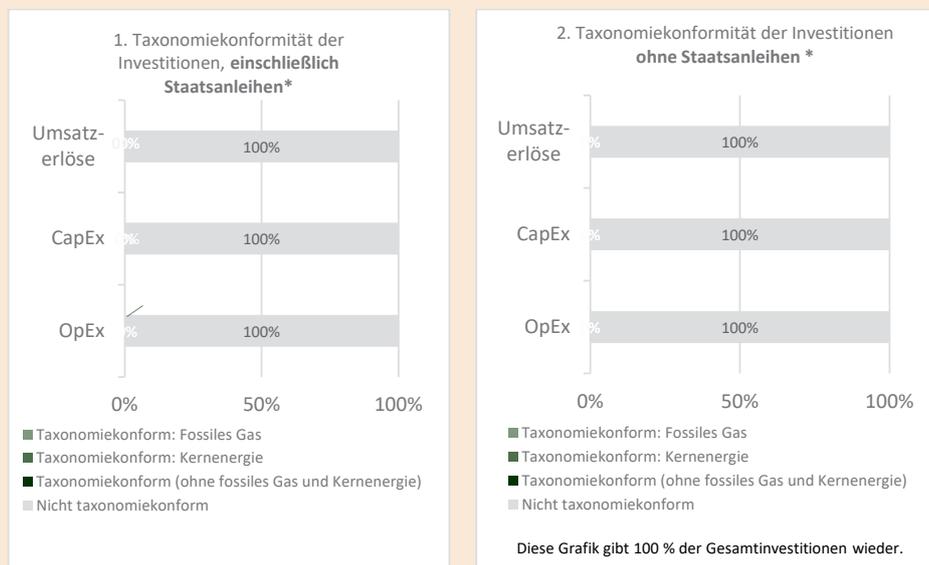
Der Fonds ist nicht verpflichtet, die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung zu erfüllen.

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden.

Wurde mit dem Finanzprodukt in mit der EU-Taxonomie konforme Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ investiert¹?



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



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

¹ Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ sind nur dann mit der EU-Taxonomie konform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links. Die vollständigen Kriterien für mit der EU-Taxonomie konforme Wirtschaftstätigkeiten in den Bereichen „Fossiles Gas“ und „Kernenergie“ sind der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission zu entnehmen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?**

0 % der vom Fonds getätigten Kapitalanlagen befinden sich in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung.

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

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden. Der Fonds hat noch keine Angleichung an die EU-Taxonomieverordnung gemeldet.



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

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren, deren Umweltziel nicht mit der EU-Taxonomieverordnung im Einklang steht.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel zu investieren.



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

Zu den als „Andere“ eingestuften Beteiligungen gehören (i) zusätzliche liquide Mittel (d. h. Sichteinlagen bei einer Bank), die zum Zwecke des Liquiditätsmanagements gehalten werden, (ii) Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente oder Geldmarktfonds, die zu steuerlichen Zwecken gehalten werden, oder (iii) Derivate zu Absicherungszwecken, (iv) Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, oder (v) Unternehmen, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen.

Diese Investitionen werden nicht zum Erfüllen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios genutzt. Der Zweck dieser Wertpapiere besteht darin, ein diversifiziertes Portfolio zu erreichen, das die finanzielle Zielstellung erreichen kann.

Mindestschutz zu Umwelt oder Sozialem wird durch Ausschluss-Screening aller Beteiligungen an Unternehmen, in die investiert wird, gewährleistet. Bei Barpositionen und Derivaten sind ESG-Erwägungen in die Bewertung des Kontrahentenrisikos integriert.

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



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

Wir führten Gespräche mit Unternehmen, mit dem Ziel, ihre Herangehensweise in Bezug auf ESG-Risiken und ESG-Praktiken zu beeinflussen. Wir haben beispielsweise im Berichtszeitraum mit Unternehmen im Portfoliobestand Gespräche zu einer Reihe von Themen geführt. Das umfasste unter anderem Gespräche mit einer Bank eines Schwellenmarkts, um ihren Ansatz in Bezug auf Nachhaltigkeit, Governance und Klimarisikomanagement besser zu verstehen, und einem Gesundheitsunternehmen zum Thema „Ethisches Marketing und Off-Label-Anwendung“ eines ihrer Medikamente.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie unterscheidet sich die Referenzbenchmark von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **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?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

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

Während des Berichtszeitraums wies das Finanzprodukt ein hervorragendes ESG-Profil gegenüber dem „MSCI All Countries World Index“ auf, gemessen am Modell „Columbia Threadneedle Investments ESG Materiality Rating“.

Bei **Referenzbenchmarks** 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: Threadneedle (Lux) Global Equity Income

Rechtsträgerkennung (LEI, Legal Entity Identifier): 549300WX6ZDL2WOHJS77

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> Ja	<input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Mit diesem Finanzprodukt wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___ %	<input type="checkbox"/> Das Finanzprodukt bewarb ökologische und soziale Merkmale und Obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt das Finanzprodukt ___ % an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind	<input type="checkbox"/> Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind
<input type="checkbox"/> In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind	<input type="checkbox"/> Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind
<input type="checkbox"/> Mit dem Finanzprodukt wurden nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___ %	<input type="checkbox"/> Mit einem sozialen Ziel
	<input checked="" type="checkbox"/> Mit dem Finanzprodukt wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Kapitalanlage in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines 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 in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel können taxonomiekonform sein oder auch nicht.



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

Anhand von **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden.

Das Finanzprodukt bewirbt ökologische und soziale Merkmale, indem es die folgenden Maßnahmen eines verantwortungsbewussten Investments in den Entscheidungsprozess für Kapitalanlagen beinhaltet:

- Übertreffen des Verzeichnisses grundlegender ESG-Kriterien, gemessen anhand des Modells „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ über rollierende 12-monatige Zeiträume
- Beibehaltung von mindestens 50 % an Portfoliobeständen an Unternehmen, die ein Rating von 1 bis 3 beim „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ aufweisen. Bei Notwendigkeit durch Bewertung von Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder durch Zusammenarbeit mit Unternehmen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird.
- Ausschluss von Unternehmen, die gegen anerkannte internationale Standards und Prinzipien wie den „United Nations Global Compact“ (Global Pakt der Vereinten Nationen) und die „United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights“ (UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte) verstoßen
- Ausschluss von Unternehmen, die gemäß der „Columbia Threadneedle Controversial Weapons Policy“ an kontroversen Waffen beteiligt sind, und von Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen
- Zur Unterstützung der Bewertung von ökologischen und sozialen Merkmalen gehen wir auf Unternehmen zu und wirken bei den Managementteams auf die Verbesserung hin, zum Beispiel bei Fragen im Zusammenhang mit CO₂-Emissionen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Das Finanzprodukt weist folgende Nachhaltigkeitsindikatoren auf:

- Der primäre Indikator ist das positive gewichtete durchschnittliche „ESG Materiality Rating“ des Portfolios im Vergleich zum „MSCI All Countries World Index“, bewertet über rollierende 12-monatige Zeiträume. Das positive „ESG Materiality Rating“ gegenüber dem Index wurde täglich von unseren Compliance-Systemen überwacht. Das Portfolio wies während des Berichtszeitraums ein besseres „ESG Materiality Rating“ auf als die Benchmark. Am 31. März 2023 lag das Rating des Portfolios bei 2,38 und das Benchmarkrating bei 2,78 (auf einer Skala von 1 bis 5, je niedriger, desto besser).
- Wir investierten mindestens 50 % des Portfolios in Unternehmen mit einem starken „ESG Materiality Rating“. Bei Notwendigkeit bewerten wir Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder wir arbeiten mit Unternehmen zusammen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird. Das Finanzprodukt behielt im Berichtszeitraum seine Beteiligungen von über 50 % an Unternehmen mit einem Rating von 1 bis 3 bei.
- Wir schlossen Unternehmen aus, die unserer Ansicht nach gegen anerkannte internationale Standards verstoßen haben, zum Beispiel gegen die „UN Global Compact Principals“. Die Einhaltung der Ausschlusspolitik wurde durch die Anwendung strenger Vorhandelsbeschränkungen gewährleistet und kontinuierlich überwacht.
- Zudem hielten wir die „Controversial Weapons Policy“ ein und schlossen Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen aus.

Da diese Indikatoren die Grundlage für die vom Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bilden, sind die Indikatoren auch die verbindlichen Elemente der ESG-Strategie des Portfolios.

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

Eine Gegenüberstellung der Nachhaltigkeitsindikatoren zu einem vergangenen Zeitraum werden wir im nächsten Bericht vorlegen.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den „OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen“ und den „UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte“ in Einklang? Nähere Angaben:

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

In der EU-Taxonomie ist das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ 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.

Auch alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele nicht erheblich beeinträchtigen.

Bei den wesentlichen 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?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.



Was waren die wesentlichen Investitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst diejenigen Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden.

Größte Investitionen	Durchschnittliche Gewichtung	Wirtschaftszweig	Land
MICROSOFT CORP	3,67 %	Informations-technologie	Vereinigte Staaten
SAMSUNG ELECTRONICS LTD	2,43 %	Informations-technologie	Korea (Süd), Republik
SIEMENS N AG	2,31 %	Industriegüter	Deutschland
STATE STREET CORP	2,22 %	Finanzen	Vereinigte Staaten
ANGLO AMERICAN PLC	2,17 %	Roh- und Grundstoffe	Südafrika
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	2,08 %	Finanzen	Vereinigte Staaten
TOTALENERGIES	2,05 %	Energie	Frankreich
BRISTOL MYERS SQUIBB	1,96 %	Gesundheitswesen	Vereinigte Staaten
ELI LILLY	1,93 %	Gesundheitswesen	Vereinigte Staaten
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	1,91 %	Informations-technologie	Taiwan (Republik China)
XCEL ENERGY INC	1,89 %	Versorgungsunternehmen	Vereinigte Staaten
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,89 %	Basiskonsumgüter	Vereinigtes Königreich
EXPERIAN PLC	1,86 %	Industriegüter	Vereinigtes Königreich
ELEVANCE HEALTH INC	1,86 %	Gesundheitswesen	Vereinigte Staaten
DEUTSCHE TELEKOM AG	1,84 %	Kommunikationsdienstleistungen	Deutschland



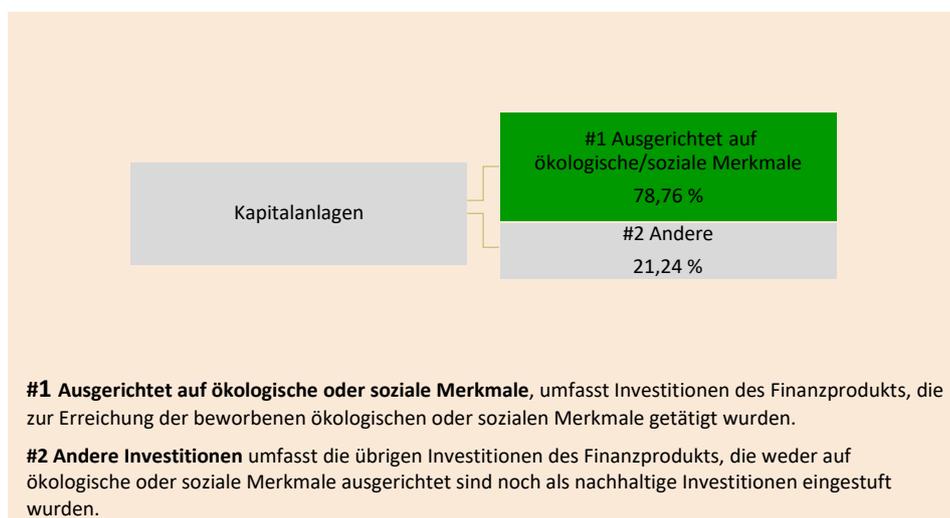
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

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

78,76 % des Finanzprodukts waren in Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 1 bis 3 investiert und somit auf ökologische/soziale Merkmale ausgerichtet.

21,24 % des Finanzprodukts waren investiert in: (1) Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, die daher nicht mit ökologischen/sozialen Merkmalen in Einklang standen, (2) Unternehmen, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen, und (3) Barmittel und Derivate.



● *In welchen Wirtschaftszweigen wurden die Investitionen getätigt?*

Wirtschaftszweig	Durchschnittliche Gewichtung
Finanzen	16,90 %
Informationstechnologie	14,91 %
Gesundheitswesen	12,32 %
Industriegüter	11,76 %
Basiskonsumgüter	9,04 %
Nicht-Basiskonsumgüter	7,25 %
Roh- und Grundstoffe	6,78 %
Energie	6,20 %

Kommunikationsdienstleistungen	6,03 %
Versorgungsunternehmen	4,80 %
Immobilien	2,02 %
Barmittel	2,00 %

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

Ermöglichende Tätigkeiten ermöglichen unmittelbar, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel leisten.

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



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

Der Fonds ist nicht verpflichtet, die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung zu erfüllen.

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in mit der EU-Taxonomie konforme Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ investiert¹?

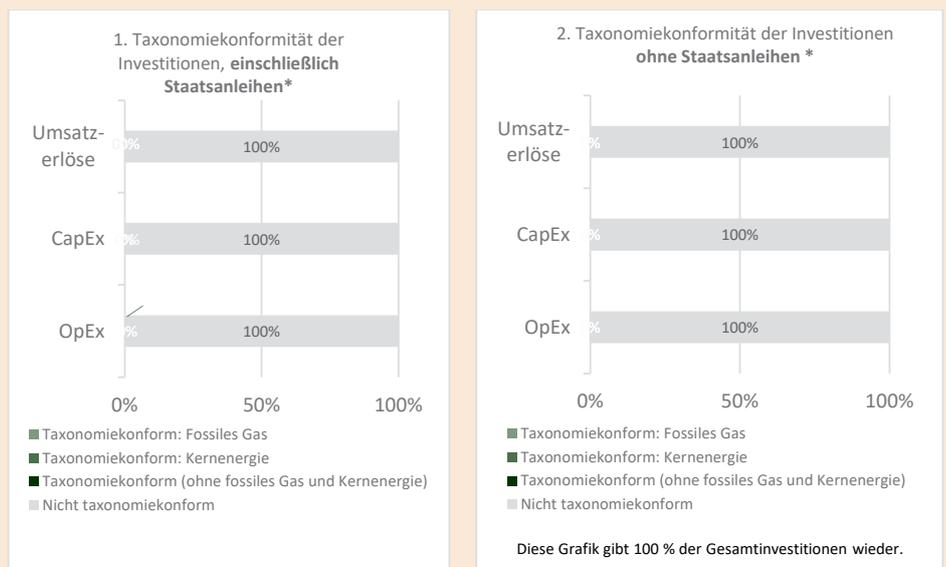
- Ja:
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ sind nur dann mit der EU-Taxonomie konform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links. Die vollständigen Kriterien für mit der EU-Taxonomie konforme Wirtschaftstätigkeiten in den Bereichen „Fossiles Gas“ und „Kernenergie“ sind der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission zu entnehmen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

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



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

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?**

0 % der vom Fonds getätigten Kapitalanlagen befinden sich in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung.

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

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden. Der Fonds hat noch keine Angleichung an die EU-Taxonomieverordnung gemeldet.

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

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren, deren Umweltziel nicht mit der EU-Taxonomieverordnung im Einklang steht.

● 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?

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel zu investieren.



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

Zu den als „Andere“ eingestuften Beteiligungen gehören (i) zusätzliche liquide Mittel (d. h. Sichteinlagen bei einer Bank), die zum Zwecke des Liquiditätsmanagements gehalten werden, (ii) Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente oder Geldmarktfonds, die zu steuerlichen Zwecken gehalten werden, oder (iii) Derivate zu Absicherungszwecken, (iv) Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, oder (v) Unternehmen, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen.

Diese Investitionen werden nicht zum Erfüllen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios genutzt. Der Zweck dieser Wertpapiere besteht darin, ein diversifiziertes Portfolio zu erreichen, das die finanzielle Zielstellung erreichen kann.

Mindestschutz zu Umwelt oder Sozialem wird durch Ausschluss-Screening aller Beteiligungen an Unternehmen, in die investiert wird, gewährleistet. Bei Barpositionen und Derivaten sind ESG-Erwägungen in die Bewertung des Kontrahentenrisikos integriert.



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

Wir führten Gespräche mit Unternehmen, mit dem Ziel, ihre Herangehensweise in Bezug auf ESG-Risiken und ESG-Praktiken zu beeinflussen. Wir haben beispielsweise im Berichtszeitraum mit Unternehmen im Portfoliobestand Gespräche zu einer Reihe von Themen geführt. Dazu gehörte unter anderem ein Gespräch mit einem Gesundheitsunternehmen zum Thema „Ethisches Marketing und Off-Label-Anwendung“ eines ihrer Arzneimittel.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

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

● **Wie unterscheidet sich die Referenzbenchmark von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

● **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?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

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

Während des Berichtszeitraums wies das Finanzprodukt ein hervorragendes ESG-Profil gegenüber dem „MSCI All Countries World Index“ auf, gemessen am Modell „Columbia Threadneedle Investments ESG Materiality Rating“.

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: Threadneedle (Lux) Global Select

Rechtsträgerkennung (LEI, Legal Entity Identifier): 5493004VNS7Y85HXL13

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Mit diesem Finanzprodukt wurden 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 qualifiziert sind <input type="checkbox"/> In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind <input type="checkbox"/> Mit dem Finanzprodukt wurden nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___ %	<input type="checkbox"/> Das Finanzprodukt bewarb ökologische und soziale Merkmale und Obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt das Finanzprodukt ___ % 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 qualifiziert sind <input type="checkbox"/> Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind <input type="checkbox"/> Mit einem sozialen Ziel <input checked="" type="checkbox"/> Mit dem Finanzprodukt wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Kapitalanlage in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines 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 in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel können taxonomiekonform sein oder auch nicht.



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

Anhand von **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden.

Das Finanzprodukt bewirbt ökologische und soziale Merkmale, indem es die folgenden Maßnahmen eines verantwortungsbewussten Investments in den Entscheidungsprozess für Kapitalanlagen beinhaltet:

- Übertreffen des Verzeichnisses grundlegender ESG-Kriterien, gemessen anhand des Modells „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ über rollierende 12-monatige Zeiträume

- Beibehaltung von mindestens 50 % an Portfoliobeständen an Unternehmen, die ein Rating von 1 bis 3 beim „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ aufweisen. Bei Notwendigkeit durch Bewertung von Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder durch Zusammenarbeit mit Unternehmen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird.
- Ausschluss von Unternehmen, die gegen anerkannte internationale Standards und Prinzipien wie den „United Nations Global Compact“ (Global Pakt der Vereinten Nationen) und die „United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights“ (UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte) verstoßen
- Ausschluss von Unternehmen, die gemäß der „Columbia Threadneedle Controversial Weapons Policy“ an kontroversen Waffen beteiligt sind, und von Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen
- Zur Unterstützung der Bewertung von ökologischen und sozialen Merkmalen gehen wir auf Unternehmen zu und wirken bei den Managementteams auf die Verbesserung hin, zum Beispiel bei Fragen im Zusammenhang mit CO₂-Emissionen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Das Finanzprodukt weist folgende Nachhaltigkeitsindikatoren auf:

- Der primäre Indikator ist das positive gewichtete durchschnittliche „ESG Materiality Rating“ des Portfolios im Vergleich zum „MSCI All Countries World Index“, bewertet über rollierende 12-monatige Zeiträume. Das positive „ESG Materiality Rating“ gegenüber dem Index wurde täglich von unseren Compliance-Systemen überwacht. Das Portfolio wies während des Berichtszeitraums ein besseres „ESG Materiality Rating“ auf als die Benchmark. Am 31. März 2023 lag das Rating des Portfolios bei 2,54 und das Benchmarkrating bei 2,78 (auf einer Skala von 1 bis 5, je niedriger, desto besser).
- Wir investierten mindestens 50 % des Portfolios in Unternehmen mit einem starken „ESG Materiality Rating“. Bei Notwendigkeit bewerten wir Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder wir arbeiten mit Unternehmen zusammen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird. Das Finanzprodukt behielt im Berichtszeitraum seine Beteiligungen von über 50 % an Unternehmen mit einem Rating von 1 bis 3 bei.
- Wir schlossen Unternehmen aus, die unserer Ansicht nach gegen anerkannte internationale Standards verstoßen haben, zum Beispiel gegen die „UN Global Compact Principals“. Die Einhaltung der Ausschlusspolitik wurde durch die Anwendung strenger Vorhandelsbeschränkungen gewährleistet und kontinuierlich überwacht.
- Zudem hielten wir die „Controversial Weapons Policy“ ein und schlossen Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen aus.

Da diese Indikatoren die Grundlage für die vom Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bilden, sind die Indikatoren auch die verbindlichen Elemente der ESG-Strategie des Portfolios.

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

Eine Gegenüberstellung der Nachhaltigkeitsindikatoren zu einem vergangenen Zeitraum werden wir im nächsten Bericht vorlegen.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

— *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den „OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen“ und den „UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte“ in Einklang? Nähere Angaben:*

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

In der EU-Taxonomie ist das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ 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.

Auch alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele nicht erheblich beeinträchtigen.

Bei den wesentlichen 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 wesentlichsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.



Was waren die wesentlichen Investitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst diejenigen Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden.

Größte Investitionen	Wirtschafts-zweig	Durchschnittliche Gewichtung	Land
MICROSOFT CORP	5,84 %	Informationstechnologie	Vereinigte Staaten
ALPHABET INC CLASS A	4,21 %	Kommunikationsdienstleistungen	Vereinigte Staaten
AMAZON COM INC	3,97 %	Nicht-Basiskonsumgüter	Vereinigte Staaten
MASTERCARD INC CLASS A	3,21 %	Finanzen	Vereinigte Staaten
T MOBILE US INC	2,80 %	Kommunikationsdienstleistungen	Vereinigte Staaten
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2,64 %	Informationstechnologie	Taiwan (Republik China)
TOTALENERGIES	2,14 %	Energie	Frankreich
JPMORGAN CHASE	2,09 %	Finanzen	Vereinigte Staaten
INTUIT INC	1,93 %	Informationstechnologie	Vereinigte Staaten
HDFC BANK LTD	1,92 %	Finanzen	Indien
NESTLE SA	1,85 %	Basiskonsumgüter	Schweiz
SCHNEIDER ELECTRIC	1,77 %	Industriegüter	Frankreich
NOVO NORDISK CLASS B	1,72 %	Gesundheitswesen	Dänemark
QUALCOMM INC	1,71 %	Informationstechnologie	Vereinigte Staaten
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,64 %	Gesundheitswesen	Vereinigte Staaten



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

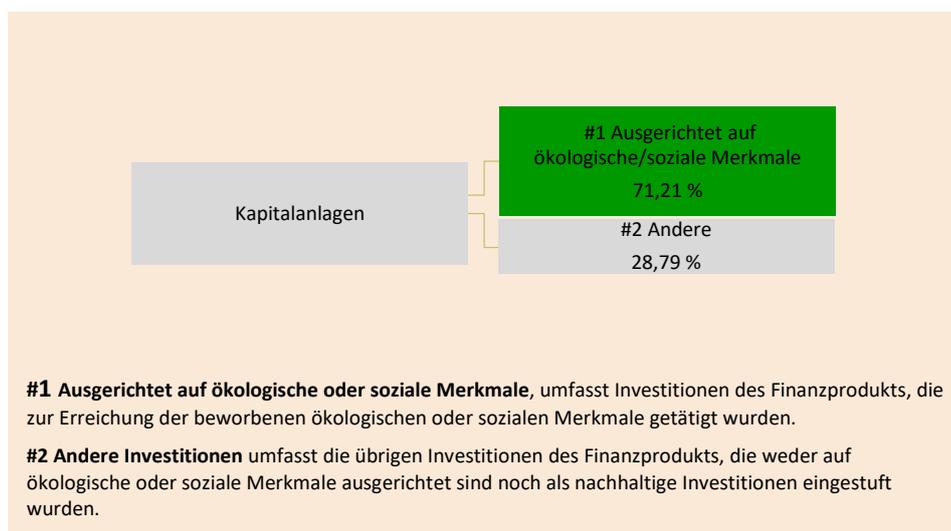
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

71,21 % des Finanzprodukts waren in Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 1 bis 3 investiert und somit auf ökologische/soziale Merkmale ausgerichtet.

28,79 % des Finanzprodukts waren investiert in: (1) Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, die daher nicht mit ökologischen/sozialen

Merkmale in Einklang standen, (2) Unternehmen, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen, und (3) Barmittel und Derivate.



● **In welchen Wirtschaftszweigen wurden die Investitionen getätigt?**

Wirtschaftszweig	Durchschnittliche Gewichtung
Informationstechnologie	23,24 %
Finanzen	16,50 %
Gesundheitswesen	12,84 %
Kommunikationsdienstleistungen	10,32 %
Industriegüter	7,99 %
Nicht-Basiskonsumgüter	7,54 %
Roh- und Grundstoffe	5,57 %
Basiskonsumgüter	4,30 %
Energie	4,17 %
Versorgungsunternehmen	3,11 %
Immobilien	2,22 %
Keine	2,19 %

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

Ermöglichende Tätigkeiten ermöglichen unmittelbar, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel leisten.

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

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



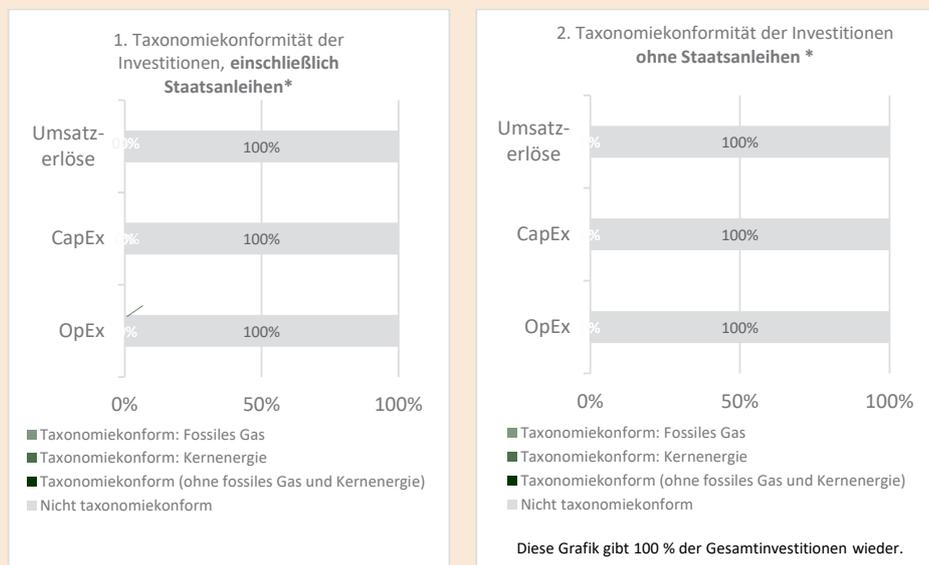
Der Fonds ist nicht verpflichtet, die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung zu erfüllen.

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in mit der EU-Taxonomie konforme Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ investiert¹?



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



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

¹ Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ sind nur dann mit der EU-Taxonomie konform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links. Die vollständigen Kriterien für mit der EU-Taxonomie konforme Wirtschaftstätigkeiten in den Bereichen „Fossiles Gas“ und „Kernenergie“ sind der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission zu entnehmen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?**

0 % der vom Fonds getätigten Kapitalanlagen befinden sich in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung.

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

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden. Der Fonds hat noch keine Angleichung an die EU-Taxonomieverordnung gemeldet.



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

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren, deren Umweltziel nicht mit der EU-Taxonomieverordnung im Einklang steht.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel zu investieren.



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

Zu den als „Andere“ eingestuften Beteiligungen gehören (i) zusätzliche liquide Mittel (d. h. Sichteinlagen bei einer Bank), die zum Zwecke des Liquiditätsmanagements gehalten werden, (ii) Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente oder Geldmarktfonds, die zu steuerlichen Zwecken gehalten werden, oder (iii) Derivate zu Absicherungszwecken, (iv) Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, oder (v) Unternehmen, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen.

Diese Investitionen werden nicht zum Erfüllen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios genutzt. Der Zweck dieser Wertpapiere besteht darin, ein diversifiziertes Portfolio zu erreichen, das die finanzielle Zielstellung erreichen kann.

Mindestschutz zu Umwelt oder Sozialem wird durch Ausschluss-Screening aller Beteiligungen an Unternehmen, in die investiert wird, gewährleistet. Bei Barpositionen und Derivaten sind ESG-Erwägungen in die Bewertung des Kontrahentenrisikos integriert.

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



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

Wir führten Gespräche mit Unternehmen, mit dem Ziel, ihre Herangehensweise in Bezug auf ESG-Risiken und ESG-Praktiken zu beeinflussen. Wir haben beispielsweise im Berichtszeitraum mit Unternehmen im Portfoliobestand Gespräche zu einer Reihe von Themen geführt. Das umfasste unter anderem Gespräche mit einem Immobilienunternehmen, um ihre Tätigkeiten in Bezug auf Emissionen und Wasserwirtschaft besser zu verstehen, und einem Gesundheitsunternehmen zum Thema „Ethisches Marketing und Off-Label-Anwendung“ eines ihrer Medikamente.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie unterscheidet sich die Referenzbenchmark von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **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?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

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

Während des Berichtszeitraums wies das Finanzprodukt ein hervorragendes ESG-Profil gegenüber dem „MSCI All Countries World Index“ auf, gemessen am Modell „Columbia Threadneedle Investments ESG Materiality Rating“.

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: Threadneedle (Lux) Global Smaller Companies

Rechtsträgerkennung (LEI, Legal Entity Identifier): 549300U3LV1YG52NP397

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Mit diesem Finanzprodukt wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___ %	<input type="checkbox"/> Das Finanzprodukt bewarb ökologische und soziale Merkmale und Obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt das Finanzprodukt ___ % an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind	<input type="checkbox"/> Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind
<input type="checkbox"/> In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind	<input type="checkbox"/> Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind
<input type="checkbox"/> Mit dem Finanzprodukt wurden nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___ %	<input type="checkbox"/> Mit einem sozialen Ziel
	<input checked="" type="checkbox"/> Mit dem Finanzprodukt wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Kapitalanlage in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines 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 in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel können taxonomiekonform sein oder auch nicht.



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

Anhand von **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden.

Das Finanzprodukt bewirbt ökologische und soziale Merkmale, indem es die folgenden Maßnahmen eines verantwortungsbewussten Investments in den Entscheidungsprozess für Kapitalanlagen beinhaltet:

- Übertreffen des Verzeichnisses grundlegender ESG-Kriterien, gemessen anhand des Modells „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ über rollierende 12-monatige Zeiträume
- Beibehaltung von mindestens 50 % an Portfoliobeständen an Unternehmen, die ein Rating von 1 bis 3 beim „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ aufweisen. Bei Notwendigkeit durch Bewertung von Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder durch Zusammenarbeit mit Unternehmen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird.
- Ausschluss von Unternehmen, die gegen anerkannte internationale Standards und Prinzipien wie den „United Nations Global Compact“ (Global Pakt der Vereinten Nationen) und die „United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights“ (UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte) verstoßen
- Ausschluss von Unternehmen, die gemäß der „Columbia Threadneedle Controversial Weapons Policy“ an kontroversen Waffen beteiligt sind, und von Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen
- Zur Unterstützung der Bewertung von ökologischen und sozialen Merkmalen gehen wir auf Unternehmen zu und wirken bei den Managementteams auf die Verbesserung hin, zum Beispiel bei Fragen im Zusammenhang mit CO₂-Emissionen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Das Finanzprodukt weist folgende Nachhaltigkeitsindikatoren auf:

- Der primäre Indikator ist das positive gewichtete durchschnittliche „ESG Materiality Rating“ des Portfolios gegenüber dem „MSCI World Small Cap Index“, bewertet über rollierende 12-monatige Zeiträume. Das positive „ESG Materiality Rating“ gegenüber dem Index wurde täglich von unseren Compliance-Systemen überwacht. Das Portfolio wies während des Berichtszeitraums ein besseres „ESG Materiality Rating“ auf als die Benchmark. Am 31. März 2023 lag das Rating des Portfolios bei 2,70 und das Benchmarkrating bei 2,99 (auf einer Skala von 1 bis 5, je niedriger, desto besser).
- Wir investierten mindestens 50 % des Portfolios in Unternehmen mit einem starken „ESG Materiality Rating“. Bei Notwendigkeit bewerten wir Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder wir arbeiten mit Unternehmen zusammen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird. Das Finanzprodukt behielt im Berichtszeitraum seine Beteiligungen von über 50 % an Unternehmen mit einem Rating von 1 bis 3 bei.
- Wir schlossen Unternehmen aus, die unserer Ansicht nach gegen anerkannte internationale Standards verstoßen haben, zum Beispiel gegen die „UN Global Compact Principals“. Die Einhaltung der Ausschlusspolitik wurde durch die Anwendung strenger Vorhandelsbeschränkungen gewährleistet und kontinuierlich überwacht.
- Zudem hielten wir die „Controversial Weapons Policy“ ein und schlossen Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen aus.

Da diese Indikatoren die Grundlage für die vom Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bilden, sind die Indikatoren auch die verbindlichen Elemente der ESG-Strategie des Portfolios.

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

Eine Gegenüberstellung der Nachhaltigkeitsindikatoren zu einem vergangenen Zeitraum werden wir im nächsten Bericht vorlegen.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

— *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den „OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen“ und den „UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte“ in Einklang? Nähere Angaben:*

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

In der EU-Taxonomie ist das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ 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.

Auch alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele nicht erheblich beeinträchtigen.

Bei den wesentlichen 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 wesentlichsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.



Was waren die wesentlichen Investitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst diejenigen Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden.

Größte Investitionen	Wirtschafts- zweig	Durchschnittliche Gewichtung	Land
KADANT INC	2,05 %	Industriegüter	Vereinigte Staaten
WILLSCOT MOBILE MINI HOLDINGS CORP	2,02 %	Industriegüter	Vereinigte Staaten
ALTAIR ENGINEERING INC CLASS A	1,98 %	Informationstechnologie	Vereinigte Staaten
CONMED CORP	1,79 %	Gesundheitswesen	Vereinigte Staaten
MSA SAFETY INC	1,74 %	Industriegüter	Vereinigte Staaten
ARMSTRONG WORLD	1,73 %	Industriegüter	Vereinigte Staaten
WORKIVA INC CLASS A	1,65 %	Informationstechnologie	Vereinigte Staaten
AAON INC	1,55 %	Industriegüter	Vereinigte Staaten
SIMPSON MANUFACTURING INC	1,54 %	Industriegüter	Vereinigte Staaten
CARGOJET INC	1,53 %	Industriegüter	Kanada
SIG GROUP N AG	1,50 %	Roh- und Grundstoffe	Schweiz
GAMES WORKSHOP GROUP PLC	1,49 %	Nicht-Basiskonsumgüter	Vereinigtes Königreich
LESLIES INC	1,48 %	Nicht-Basiskonsumgüter	Vereinigte Staaten
SQUARE ENIX HLDG LTD	1,47 %	Kommunikations-	Japan
ADVANCED DRAINAGE	1,44 %	Industriegüter	Vereinigte Staaten



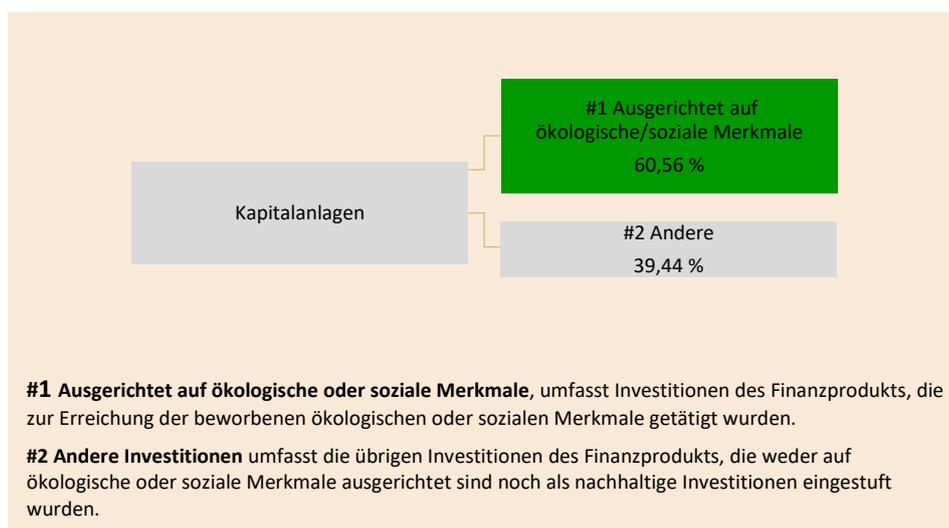
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

60,56 % des Finanzprodukts waren in Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 1 bis 3 investiert und somit auf ökologische/soziale Merkmale ausgerichtet.

39,44 % des Finanzprodukts waren investiert in: (1) Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, die daher nicht mit ökologischen/sozialen Merkmalen in Einklang standen, (2) Unternehmen, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen, und (3) Barmittel und Derivate.

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



● **In welchen Wirtschaftszweigen wurden die Investitionen getätigt?**

Wirtschaftszweig	Durchschnittliche Gewichtung
Industriegüter	30,21 %
Informationstechnologie	18,71 %
Gesundheitswesen	15,27 %
Nicht-Basiskonsumgüter	13,50 %
Finanzen	6,74 %
Kommunikationsdienstleistungen	6,58 %
Basiskonsumgüter	3,42 %
Roh- und Grundstoffe	2,82 %
Immobilien	0,65 %
Barmittel	2,09 %

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

Ermöglichende Tätigkeiten ermöglichen unmittelbar, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel leisten.

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



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

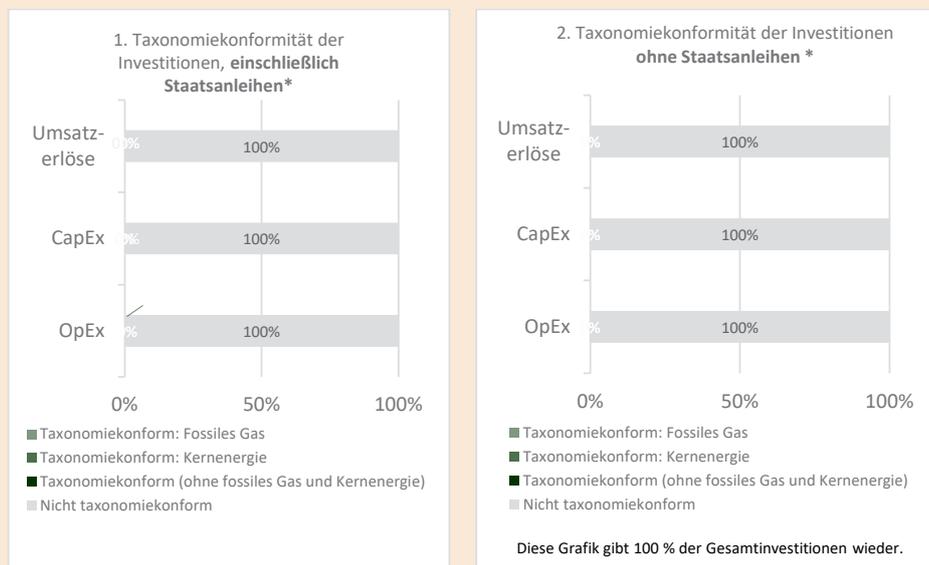
Der Fonds ist nicht verpflichtet, die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung zu erfüllen.

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden.

Wurde mit dem Finanzprodukt in mit der EU-Taxonomie konforme Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ investiert¹?



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



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

¹ Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ sind nur dann mit der EU-Taxonomie konform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links. Die vollständigen Kriterien für mit der EU-Taxonomie konforme Wirtschaftstätigkeiten in den Bereichen „Fossiles Gas“ und „Kernenergie“ sind der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission zu entnehmen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?**

0 % der vom Fonds getätigten Kapitalanlagen befinden sich in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung.

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

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden. Der Fonds hat noch keine Angleichung an die EU-Taxonomieverordnung gemeldet.

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

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren, deren Umweltziel nicht mit der EU-Taxonomieverordnung im Einklang steht.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel zu investieren.

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

Zu den als „Andere“ eingestuften Beteiligungen gehören (i) zusätzliche liquide Mittel (d. h. Sichteinlagen bei einer Bank), die zum Zwecke des Liquiditätsmanagements gehalten werden, (ii) Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente oder Geldmarktfonds, die zu steuerlichen Zwecken gehalten werden, oder (iii) Derivate zu Absicherungszwecken, (iv) Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, oder (v) Unternehmen, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen.

Diese Investitionen werden nicht zum Erfüllen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios genutzt. Der Zweck dieser Wertpapiere besteht darin, ein diversifiziertes Portfolio zu erreichen, das die finanzielle Zielstellung erreichen kann.

Mindestschutz zu Umwelt oder Sozialem wird durch Ausschluss-Screening aller Beteiligungen an Unternehmen, in die investiert wird, gewährleistet. Bei Barpositionen und Derivaten sind ESG-Erwägungen in die Bewertung des Kontrahentenrisikos integriert.

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



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

Wir führten Gespräche mit Unternehmen, mit dem Ziel, ihre Herangehensweise in Bezug auf ESG-Risiken und ESG-Praktiken zu beeinflussen. Wir haben beispielsweise im Berichtszeitraum mit Unternehmen im Portfoliobestand Gespräche zu einer Reihe von Themen geführt. Dazu gehörten unter anderem Gespräche mit einer US-Bank, um die Governance-Struktur des Unternehmens besser zu verstehen, insbesondere in Bezug auf die Struktur und die Vergütung des Boards of Directors.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie unterscheidet sich die Referenzbenchmark von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **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?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

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

Während des Berichtszeitraums wies das Finanzprodukt ein hervorragendes ESG-Profil gegenüber dem „MSCI World Small Cap Index“ auf, gemessen am Modell „Columbia Threadneedle Investments ESG Materiality Rating“.

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: Threadneedle (Lux) American Smaller Companies

Rechtsträgerkennung (LEI, Legal Entity Identifier): 549300FL849SFZ3EMB26

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Nein
<input type="checkbox"/> Mit diesem Finanzprodukt wurden 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 qualifiziert sind <input type="checkbox"/> In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind <input type="checkbox"/> Mit dem Finanzprodukt wurden nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___ %	<input type="checkbox"/> Das Finanzprodukt bewarb ökologische und soziale Merkmale und Obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt das Finanzprodukt ___ % 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 qualifiziert sind <input type="checkbox"/> Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind <input type="checkbox"/> Mit einem sozialen Ziel <input checked="" type="checkbox"/> Mit dem Finanzprodukt wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Kapitalanlage in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines 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 in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel können taxonomiekonform sein oder auch nicht.



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

Anhand von **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden.

Das Finanzprodukt bewirbt ökologische und soziale Merkmale, indem es die folgenden Maßnahmen eines verantwortungsbewussten Investments in den Entscheidungsprozess für Kapitalanlagen beinhaltet:

- Übertreffen des Verzeichnisses grundlegender ESG-Kriterien, gemessen anhand des Modells „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ über rollierende 12-monatige Zeiträume
- Beibehaltung von mindestens 50 % an Portfoliobeständen an Unternehmen, die ein Rating von 1 bis 3 beim „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ aufweisen. Bei Notwendigkeit durch Bewertung von Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder durch Zusammenarbeit mit Unternehmen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird.
- Ausschluss von Unternehmen, die gegen anerkannte internationale Standards und Prinzipien wie den „United Nations Global Compact“ (Global Pakt der Vereinten Nationen) und die „United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights“ (UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte) verstoßen
- Ausschluss von Unternehmen, die gemäß der „Columbia Threadneedle Controversial Weapons Policy“ an kontroversen Waffen beteiligt sind, und von Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen
- Zur Unterstützung der Bewerbung von ökologischen und sozialen Merkmalen gehen wir auf Unternehmen zu und wirken bei den Managementteams auf die Verbesserung hin, zum Beispiel bei Fragen im Zusammenhang mit CO₂-Emissionen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Das Finanzprodukt weist folgende Nachhaltigkeitsindikatoren auf:

- Der primäre Indikator ist das positive gewichtete durchschnittliche „ESG Materiality Rating“ des Portfolios im Vergleich zum „Russel 2500 Index“, bewertet über rollierende 12-monatige Zeiträume. Das positive „ESG Materiality Rating“ gegenüber dem Index wurde täglich von unseren Compliance-Systemen überwacht. Das Portfolio wies während des Berichtszeitraums ein besseres „ESG Materiality Rating“ auf als die Benchmark. Am 31. März 2023 lag das Rating des Portfolios bei 2,41 und das Benchmarkrating bei 2,97 (auf einer Skala von 1 bis 5, je niedriger, desto besser).
- Wir investierten mindestens 50 % des Portfolios in Unternehmen mit einem starken „ESG Materiality Rating“. Bei Notwendigkeit bewerten wir Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder wir arbeiten mit Unternehmen zusammen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird. Das Finanzprodukt behielt im Berichtszeitraum seine Beteiligungen von über 50 % an Unternehmen mit einem Rating von 1 bis 3 bei.
- Wir schlossen Unternehmen aus, die unserer Ansicht nach gegen anerkannte internationale Standards verstoßen haben, zum Beispiel gegen die „UN Global Compact Principals“. Die Einhaltung der Ausschlusspolitik wurde durch die Anwendung strenger Verhandelsbeschränkungen gewährleistet und kontinuierlich überwacht.
- Zudem hielten wir die „Controversial Weapons Policy“ ein und schlossen Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen aus.

Da diese Indikatoren die Grundlage für die vom Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bilden, sind die Indikatoren auch die verbindlichen Elemente der ESG-Strategie des Portfolios.

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

Eine Gegenüberstellung der Nachhaltigkeitsindikatoren zu einem vergangenen Zeitraum werden wir im nächsten Bericht vorlegen.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den „OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen“ und den „UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte“ in Einklang? Nähere Angaben:

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

In der EU-Taxonomie ist das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ 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.

Auch alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele nicht erheblich beeinträchtigen.

Bei den **wesentlichen 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 wesentlichsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.



Was waren die wesentlichen Investitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Wirtschafts-zweig	Durchschnittliche Gewichtung	Land
WILLSCOT MOBILE MINI HOLDINGS CORP	Industriegüter	3,83 %	Vereinigte Staaten
AVISTA CORP	Versorgungsunternehmen	3,76 %	Vereinigte Staaten
CONMED CORP	Gesundheitswesen	3,54 %	Vereinigte Staaten
CARRIAGE SERVICES INC	Nicht-Basiskonsumgüter	3,32 %	Vereinigte Staaten
NEWPARK RESOURCES INC	Energie	3,12 %	Vereinigte Staaten
VOYA FINANCIAL INC	Finanzen	2,97 %	Vereinigte Staaten
KONTOOR BRANDS INC	Nicht-Basiskonsumgüter	2,90 %	Vereinigte Staaten
MOELIS CLASS A	Finanzen	2,53 %	Vereinigte Staaten
HOULIHAN LOKEY INC CLASS A	Finanzen	2,47 %	Vereinigte Staaten
VIRTU FINANCIAL INC CLASS A	Finanzen	2,41 %	Vereinigte Staaten
NOV INC	Energie	2,35 %	Vereinigte Staaten
FTI CONSULTING INC	Industriegüter	2,29 %	Vereinigte Staaten
SCHNITZER STEEL INDUSTRIES INC CLASS A	Roh- und Grundstoffe	2,16 %	Vereinigte Staaten
MATTHEWS INTERNATIONAL CORP CLASS	Industriegüter	2,15 %	Vereinigte Staaten
ESSENT GROUP LTD	Finanzen	1,92 %	Vereinigte Staaten

Die Liste umfasst diejenigen Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden.



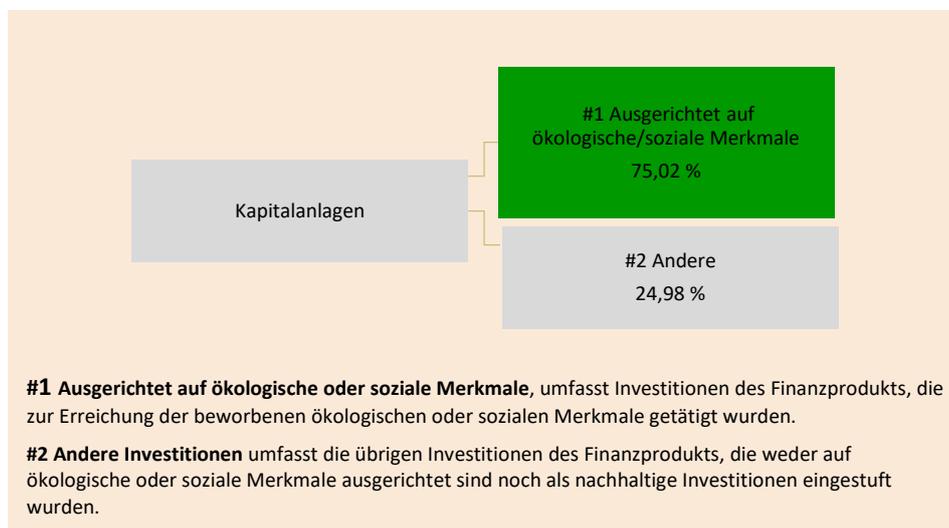
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

75,02 % des Finanzprodukts waren in Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 1 bis 3 investiert und somit auf ökologische/soziale Merkmale ausgerichtet.

24,98 % des Finanzprodukts waren investiert in: (1) Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, die daher nicht mit ökologischen/sozialen Merkmalen in Einklang standen, (2) Unternehmen, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen, und (3) Barmittel und Derivate.

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



In welchen Wirtschaftszweigen wurden die Investitionen getätigt?

Wirtschaftszweig	Durchschnittliche Gewichtung
Industriegüter	18,55 %
Finanzen	15,65 %
Nicht-Basiskonsumgüter	13,46 %
Gesundheitswesen	11,91 %
Informationstechnologie	11,28 %
Roh- und Grundstoffe	6,48 %
Basiskonsumgüter	6,27 %
Energie	5,66 %
Versorgungsunternehmen	3,76 %
Immobilien	3,02 %
Barmittel	2,54 %
Kommunikationsdienstleistungen	1,43 %

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

Ermöglichende Tätigkeiten ermöglichen unmittelbar, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel leisten.

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



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

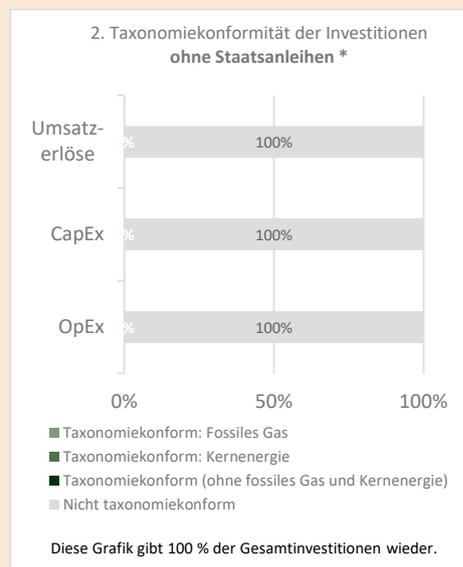
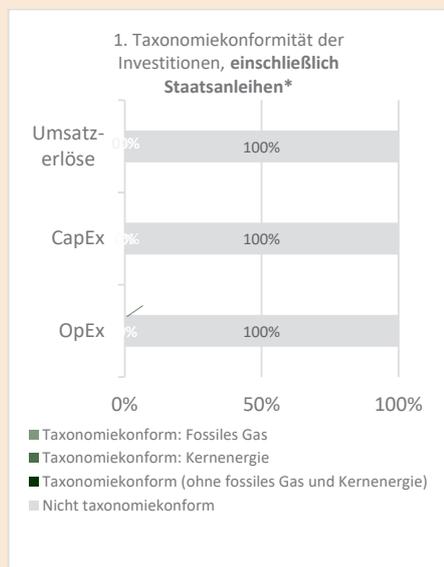
Der Fonds ist nicht verpflichtet, die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung zu erfüllen.

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in mit der EU-Taxonomie konforme Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ investiert¹?

- Ja:
 - In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

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



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

¹ Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ sind nur dann mit der EU-Taxonomie konform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links. Die vollständigen Kriterien für mit der EU-Taxonomie konforme Wirtschaftstätigkeiten in den Bereichen „Fossiles Gas“ und „Kernenergie“ sind der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission zu entnehmen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?**

0 % der vom Fonds getätigten Kapitalanlagen befinden sich in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung.

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

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden. Der Fonds hat noch keine Angleichung an die EU-Taxonomieverordnung gemeldet.



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

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren, deren Umweltziel nicht mit der EU-Taxonomieverordnung im Einklang steht.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel zu investieren.



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

Zu den als „Andere“ eingestuften Beteiligungen gehören (i) zusätzliche liquide Mittel (d. h. Sichteinlagen bei einer Bank), die zum Zwecke des Liquiditätsmanagements gehalten werden, (ii) Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente oder Geldmarktfonds, die zu steuerlichen Zwecken gehalten werden, oder (iii) Derivate zu Absicherungszwecken, (iv) Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, oder (v) Unternehmen, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen.

Diese Investitionen werden nicht zum Erfüllen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios genutzt. Der Zweck dieser Wertpapiere besteht darin, ein diversifiziertes Portfolio zu erreichen, das die finanzielle Zielstellung erreichen kann.

Mindestschutz zu Umwelt oder Sozialem wird durch Ausschluss-Screening aller Beteiligungen an Unternehmen, in die investiert wird, gewährleistet. Bei Barpositionen und Derivaten sind ESG-Erwägungen in die Bewertung des Kontrahentenrisikos integriert.



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

Wir führten Gespräche mit Unternehmen, mit dem Ziel, ihre Herangehensweise in Bezug auf ESG-Risiken und ESG-Praktiken zu beeinflussen.

Im Laufe des Berichtszeitraums sind wir beispielsweise mit Livent über die wichtigsten Livent betreffenden Themen zu Ökologie und Sozialem und ihre Fähigkeit, eine Betriebsgenehmigung zu erhalten, ins Gespräch gekommen. Das Unternehmen ist sich bewusst, dass die Betriebsgenehmigung von entscheidender Bedeutung ist und gibt an, die Menschenrechte zu priorisieren, Beziehungen in der Gemeinschaft aufzubauen und sicherzustellen, dass die Anforderungen der Kunden nach gut geprüften Lieferketten mit geringeren Auswirkungen erfüllt werden. Der Standort des Unternehmens mit dem höchsten Profil befindet sich in Argentinien. Dort traten in der Vergangenheit Probleme mit Protesten gegen den Bergbau auf. Das Unternehmen hat mit einer mit der UNO verbundenen NGO Bürgerversammlungen mit Einheimischen veranstaltet. Zudem ist sich das Unternehmen der Notwendigkeit bewusst, beständig eine freie, vorherige und informierte Zustimmung (Free, Prior and Informed Consent) aufrechtzuerhalten. Der Wunsch, die Abläufe so zu gestalten, dass auch die Gemeinden davon Nutzen haben, ist einer der Hauptgründe für die Akkreditierung von IRMA. Ein weiterer Faktor dafür ist, dass große OEMs (Livent-Kunden) im IRMA-Vorstand sind und Lieferanten aufgrund ihres Schwerpunkts auf der Rückverfolgbarkeit von Lieferketten und der Reduzierung des CO₂-Ausstoßes in diese Richtung drängen. Wasser ist ein wesentliches Thema bei der Gewinnung von Lithium. Daher hat das Unternehmen zusammen mit örtlichen Behörden und US-Universitäten eine hydrogeologische Studie der Region entwickelt, in der festgestellt wurde, dass die Gegend aufgrund lokaler geografischer Eigenheiten nicht so stark von Wasserknappheit betroffen ist wie vergleichbare Gegenden. Das Unternehmen wird in der Gegend intensiv überwacht und kommuniziert über den Wasserverbrauch mit den örtlichen Gemeinschaften sowie mit den Behörden. Livent hat das Ziel, bis 2040 Netto-Null zu sein, jedoch nur das Ziel, bis 2030 eine Reduzierung der Treibhausgasintensität von nur 30 % zu erreichen. Das bedeutet eine signifikante Reduzierung nach 2030. In der allernächsten Zeit arbeitet Livent an der Prozessoptimierung und ist zuversichtlich, dass das Ziel für 2030 erreicht wird. Längerfristig kann Livent jedoch mit Herausforderungen bei der Beschaffung erneuerbarer Energien konfrontiert sein. Die Offenlegung des Unternehmens bleibt wagen, und Pläne zur Reduzierung von Auswirkungen auf die Natur sind undeutlich. Insgesamt verfolgt Livent für ein Unternehmen seiner Größe einen soliden Ansatz in Bezug auf Themen zu Ökologie und Sozialem. Es sind jedoch konkretere Pläne und Offenlegungen zur Reduzierung der Emissionen, des Wasserverbrauchs und der Auswirkungen auf die Natur sowie stärkere, klarere Ansätze in Bezug auf Menschenrechte und Beziehungen zu den Gemeinden erforderlich.

Wir haben uns auch mit einem Schreiben an Medpace gewandt, in dem wir die Bedeutung von Diversität in klinischen Studien für uns als Anleger erläuterten. Wir haben unser Interesse gezeigt, mehr über die Unternehmensstrategie zu erfahren und forderten gleichzeitig mehr Transparenz seitens der Branche zu Themen wie dem Vertrauensaufbau mit (historisch) unterrepräsentierten Versuchsteilnehmern, Anreizen für die Teilnahme an Studien (z. B. Belohnungen, infrastrukturelle Herausforderungen, dezentrale Studien), Einstellungspraktiken, internes Bewusstsein und Kapazitätsaufbau, Zusammenarbeit mit relevanten Gruppen von Akteuren wie Patientengruppen und Brancheninitiativen sowie Rückverfolgung der Effektivität von Diversität in klinischen Versuchsstrategien, einschließlich Datenerfassung und Verwendung von Ergebnissen zur Anpassung von Ansätzen. Am Schluss der E-Mail baten wir um einen Anruf zum Besprechen der weiteren Zusammenarbeit.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie unterscheidet sich die Referenzbenchmark von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **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?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

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

Während des Berichtszeitraums wies das Finanzprodukt ein hervorragendes ESG-Profil gegenüber dem „Russell 2500 Index“ auf, gemessen am Modell „Columbia Threadneedle Investments ESG Materiality Rating“.

Bei Referenzbenchmarks 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: Threadneedle (Lux) Asia Equities

Rechtsträgerkennung (LEI, Legal Entity Identifier): 549300NJZIV56FVQ648

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> Ja	<input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Mit diesem Finanzprodukt wurden 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 qualifiziert sind <input type="checkbox"/> In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind <input type="checkbox"/> Mit dem Finanzprodukt wurden nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___ %	<input type="checkbox"/> Das Finanzprodukt bewarb ökologische und soziale Merkmale und Obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt das Finanzprodukt ___ % 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 qualifiziert sind <input type="checkbox"/> Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind <input type="checkbox"/> Mit einem sozialen Ziel <input checked="" type="checkbox"/> Mit dem Finanzprodukt wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

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

Das Finanzprodukt bewirbt ökologische und soziale Merkmale, indem es die folgenden Maßnahmen eines verantwortungsbewussten Investments in den Entscheidungsprozess für Kapitalanlagen beinhaltet:

- Übertreffen des Verzeichnisses grundlegender ESG-Kriterien, gemessen anhand des Modells „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ über rollierende 12-monatige Zeiträume



Eine **nachhaltige Investition** ist eine Kapitalanlage in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines 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 in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel können taxonomiekonform sein oder auch nicht.

Anhand von **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden.

- Beibehaltung von mindestens 50 % an Portfoliobeständen an Unternehmen, die ein Rating von 1 bis 3 beim „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ aufweisen. Bei Notwendigkeit durch Bewertung von Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder durch Zusammenarbeit mit Unternehmen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird.
- Ausschluss von Emittenten, die gegen anerkannte internationale Standards und Prinzipien wie den „United Nations Global Compact“ (Global Pakt der Vereinten Nationen) und die „United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights“ (UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte) verstoßen
- Ausschluss von Emittenten, die gemäß der „Columbia Threadneedle Controversial Weapons Policy“ an kontroversen Waffen beteiligt sind, und von Emittenten mit direkter Beteiligung an Atomwaffen
- Zur Unterstützung der Bewerbung von ökologischen und sozialen Merkmalen gehen wir auf Unternehmen zu und wirken bei den Managementteams auf die Verbesserung hin, zum Beispiel bei Fragen im Zusammenhang mit CO₂-Emissionen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Das Finanzprodukt weist folgende Nachhaltigkeitsindikatoren auf:

- Der primäre Indikator ist das positive gewichtete durchschnittliche „ESG Materiality Rating“ des Portfolios im Vergleich zum „MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index“, bewertet über rollierende 12-monatige Zeiträume. Das positive „ESG Materiality Rating“ gegenüber dem Index wurde täglich von unseren Compliance-Systemen überwacht. Das Portfolio wies während des Berichtszeitraums ein besseres „ESG Materiality Rating“ auf als die Benchmark.
Am 31. März 2023 lag das Rating des Portfolios bei 2,12 und das Benchmarkrating bei 2,30 (auf einer Skala von 1 bis 5, je niedriger, desto besser).
- Wir investierten mindestens 50 % des Portfolios in Unternehmen mit einem starken „ESG Materiality Rating“. Bei Notwendigkeit bewerten wir Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder wir arbeiten mit Unternehmen zusammen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird. Das Finanzprodukt behielt im Berichtszeitraum seine Beteiligungen von über 50 % an Emittenten mit einem Rating von 1 bis 3 bei.
- Wir schlossen Unternehmen aus, die unserer Ansicht nach gegen anerkannte internationale Standards verstoßen haben, zum Beispiel gegen die „UN Global Compact Principals“. Die Einhaltung der Ausschlusspolitik wurde durch die Anwendung strenger Vorhandelsbeschränkungen gewährleistet und kontinuierlich überwacht.
- Zudem hielten wir die „Controversial Weapons Policy“ ein und schlossen Emittenten mit direkter Beteiligung an Atomwaffen aus.

Da diese Indikatoren die Grundlage für die vom Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bilden, sind die Indikatoren auch die verbindlichen Elemente der ESG-Strategie des Portfolios.

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

Eine Gegenüberstellung der Nachhaltigkeitsindikatoren zu einem vergangenen Zeitraum werden wir im nächsten Bericht vorlegen.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den „OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen“ und den „UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte“ in Einklang? Nähere Angaben:

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

In der EU-Taxonomie ist das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ 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.

Auch alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele nicht erheblich beeinträchtigen.

Bei den wesentlichen 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?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.



Was waren die wesentlichen Investitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst diejenigen Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden; diese sind:

Größte Investitionen	Durchschnittliche Gewichtung	Land	Wirtschaftszweig
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	7,55 %	Taiwan (Republik China)	Informationstechnologie
SAMSUNG ELECTRONICS LTD	4,18 %	Korea (Süd), Republik	Informationstechnologie
TENCENT HOLDINGS LTD	3,80 %	China	Kommunikationsdienstleistungen
AIA GROUP LTD	3,57 %	Hongkong	Finanzen
RELIANCE INDUSTRIES LTD	3,00 %	Indien	Energie
MACQUARIE GROUP LTD DEF	2,65 %	Australien	Finanzen
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	2,63 %	Australien	Finanzen
JD.COM CLASS A INC	2,51 %	China	Nicht-Basiskonsumgüter
CSL LTD	2,32 %	Australien	Gesundheitswesen
BANK RAKYAT INDONESIA (PERSERO)	2,32 %	Indonesien	Finanzen
MEITUAN	2,29 %	China	Nicht-Basiskonsumgüter
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,26 %	China	Nicht-Basiskonsumgüter
UNITED OVERSEAS BANK LTD	2,21 %	Singapur	Finanzen
HDFC BANK LTD	2,18 %	Indien	Finanzen
SANTOS LTD	2,16 %	Australien	Energie



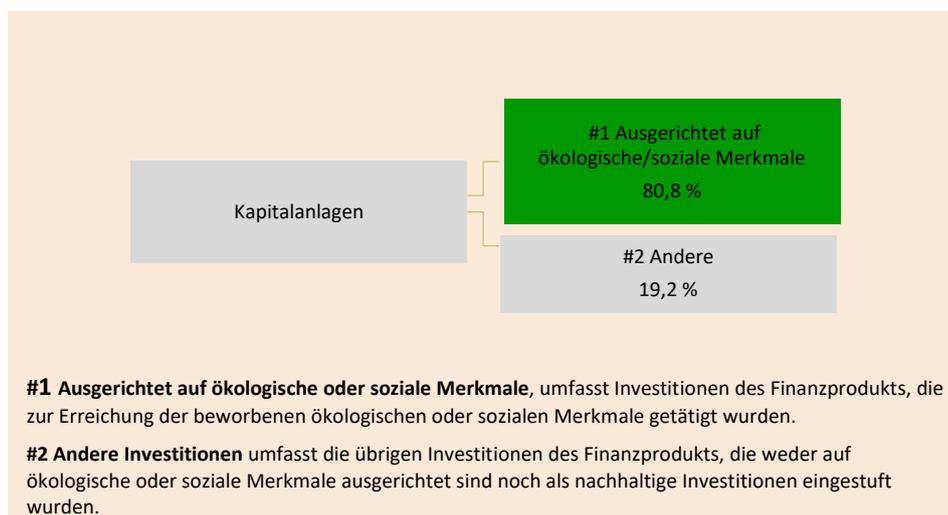
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

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

80,8 % des Finanzprodukts waren in Emittenten mit einem „ESG Materiality Rating“ von 1 bis 3 investiert und somit auf ökologische/soziale Merkmale ausgerichtet.

19,2 % des Finanzprodukts waren investiert in: (1) Emittenten mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, die daher nicht mit ökologischen/sozialen Merkmalen in Einklang standen, (2) Emittenten, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen, und (3) Barmittel und Derivate.



● In welchen Wirtschaftszweigen wurden die Investitionen getätigt?

Wirtschaftszweig	Durchschnittliche Gewichtung
Finanzen	25,16 %
Informationstechnologie	18,88 %
Nicht-Basiskonsumgüter	13,54 %
Kommunikationsdienstleistungen	9,67 %
Roh- und Grundstoffe	6,84 %
Energie	6,02 %
Industriegüter	4,73 %
Basiskonsumgüter	4,67 %
Gesundheitswesen	4,50 %
Immobilien	4,07 %

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

Ermöglichende Tätigkeiten ermöglichen unmittelbar, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel leisten.

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



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

Der Fonds ist nicht verpflichtet, die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung zu erfüllen.

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in mit der EU-Taxonomie konforme Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ investiert¹?

Ja:

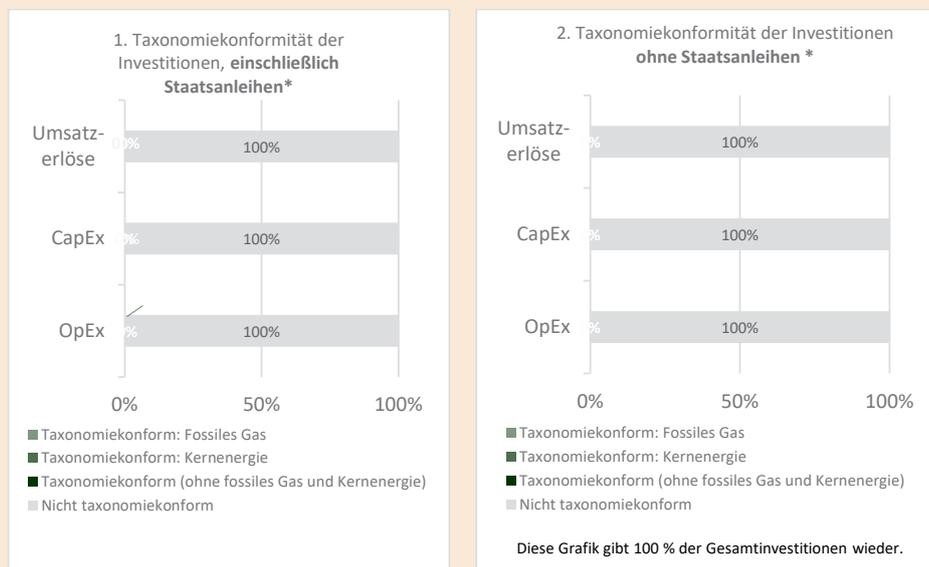
 In fossiles Gas In Kernenergie

 Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

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



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

¹ Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ sind nur dann mit der EU-Taxonomie konform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links. Die vollständigen Kriterien für mit der EU-Taxonomie konforme Wirtschaftstätigkeiten in den Bereichen „Fossiles Gas“ und „Kernenergie“ sind der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission zu entnehmen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?**

0 % der vom Fonds getätigten Kapitalanlagen befinden sich in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung.

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

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden. Der Fonds hat noch keine Angleichung an die EU-Taxonomieverordnung gemeldet.



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

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren, deren Umweltziel nicht mit der EU-Taxonomieverordnung im Einklang steht.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel zu investieren.



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

Zu den als „Andere“ eingestuften Beteiligungen gehören (i) zusätzliche liquide Mittel (d. h. Sichteinlagen bei einer Bank), die zum Zwecke des Liquiditätsmanagements gehalten werden, (ii) Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente oder Geldmarktfonds, die zu steuerlichen Zwecken gehalten werden, oder (iii) Derivate zu Absicherungszwecken, (iv) Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, oder (v) Unternehmen, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen.

Diese Investitionen werden nicht zum Erfüllen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios genutzt. Der Zweck dieser Wertpapiere besteht darin, ein diversifiziertes Portfolio zu erreichen, das die finanzielle Zielstellung erreichen kann.

Mindestschutz zu Umwelt oder Sozialem wird durch Ausschluss-Screening aller Beteiligungen an Unternehmen, in die investiert wird, gewährleistet. Bei Barpositionen und Derivaten sind ESG-Erwägungen in die Bewertung des Kontrahentenrisikos integriert.

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



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

Wir führten Gespräche mit Unternehmen, mit dem Ziel, ihre Herangehensweise in Bezug auf ESG-Risiken und ESG-Praktiken zu beeinflussen. Beispielsweise haben wir uns an Samsung Electronics Korea gewandt und in einer Nachbesprechung mit dem CSR/IR-Team des Unternehmens unsere Erwartungen aus dem vorherigen Dialog dargelegt. Wir gaben mehrere Empfehlungen, darunter spezifische Fallstudienbeispiele in Bezug auf den Prozess des Chemikalienmanagements sowie eine ausführlichere Offenlegung der Kennzahlen zum Arbeitsschutz. Dazu gehörten die Teilnahme am „Clean Electronics Production Network“ sowie Schulung von Werksmitarbeitern in Bezug auf Vereinigungsfreiheit, insbesondere in Ländern, in denen die Arbeitsrechtsvorschriften weniger konsequent umgesetzt werden. Zudem haben wir für jede unserer oben genannten Empfehlungen Beispiele für bewährte Verfahren genannt.

Auch mit der Bank Rakyat sind wir in Kontakt getreten. Dies geschah in Form eines gemeinsamen Telefonats mit dem Head of Investor Relations und dem Head of ESG. Der Schwerpunkt des Telefonats lag auf einem breiteren Ansatz des Unternehmens in Bezug auf Sustainability Governance und Risikomanagement sowie auf Klimarisikomanagement. Wir diskutierten die neue ESG-Roadmap und den aktualisierten ESG-Governance-Prozess des Unternehmens. Das Unternehmen konnte hier Fortschritte verzeichnen und verfügt nun über ein neues, spezielles ESG-Team. Insgesamt verlief das Telefonat positiv, und die Bank Rakyat ist auf einem guten Weg. Das Unternehmen verpflichtete sich, bis Anfang 2024 die TCFD-Berichterstattung, die Offenlegung der auf Investitionen zurückzuführenden Emissionen und die Verpflichtung zu Netto-Null zu aktualisieren. Das Unternehmen erwähnte, dass es sich bei den veröffentlichten Zielen um wissenschaftlich begründete Ziele handeln sollte. Das ist, vom derzeitigen Stand aus gesehen, ein recht ambitioniertes Vorhaben, und wir werden daher die Fortschritte dieses Unternehmens auf diesen Gebieten weiterhin im Auge behalten und uns weiterhin engagieren.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

● **Wie unterscheidet sich die Referenzbenchmark von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

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

- **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?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

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

Während des Berichtszeitraums wies das Finanzprodukt ein hervorragendes ESG-Profil gegenüber dem „MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index“ auf, gemessen am Modell „Columbia Threadneedle Investments ESG Materiality Rating“.

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: Threadneedle (Lux) Pan European ESG Equities

Rechtsträgerkennung (LEI, Legal Entity Identifier): 5493003HOJGB5U7D3492

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Mit diesem Finanzprodukt wurden 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 qualifiziert sind <input type="checkbox"/> In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind <input type="checkbox"/> Mit dem Finanzprodukt wurden nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___ %	<input type="checkbox"/> Das Finanzprodukt bewarb ökologische und soziale Merkmale und Obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt das Finanzprodukt ___ % 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 qualifiziert sind <input type="checkbox"/> Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind <input type="checkbox"/> Mit einem sozialen Ziel <input checked="" type="checkbox"/> Mit dem Finanzprodukt wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

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



Das Finanzprodukt bewirbt ökologische und soziale Merkmale, indem es die folgenden Maßnahmen eines verantwortungsbewussten Investments in den Entscheidungsprozess für Kapitalanlagen beinhaltet:

- Übertreffen des Verzeichnisses grundlegender ESG-Kriterien, gemessen anhand des Modells „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ über rollierende 12-monatige Zeiträume

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Kapitalanlage in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines 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 in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel können taxonomiekonform sein oder auch nicht.

Anhand von **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden.

- Wir investierten mindestens 80 % des Portfolios in Unternehmen mit starken oder sich verbessernden ESG-Merkmalen, gemessen anhand einer Kombination aus Rating „ESG Materiality“ und Fundamentaldatenanalyse der Unternehmen im Portfolio. Im Portfolio werden tendenziell Unternehmen bevorzugt, die im „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ eine hohe Punktzahl erreichen, sodass das Portfolio im Vergleich zum „MSCI Europe Index“ über rollierende 12-monatige Zeiträume eine positive Entwicklung zugunsten von ESG-Merkmalen aufweist. Alle Unternehmen mit hohem Rating werden als mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen/sozialen Merkmalen konform angesehen. Das Portfolio investiert jedoch möglicherweise auch in Unternehmen mit einem schlechteren Rating, und diese Unternehmen werden ebenfalls als an den vom Portfolio beworbenen ökologischen/sozialen Merkmalen konform angesehen, da diese Wertpapiere ungeachtet eines solchen Ratings (i) anhand unserer Fundamentalanalyse als Unternehmen bewertet werden, die bereits starke ESG-Praktiken aufweisen, oder (ii) Verbesserungen bei ihren ESG-Praktiken in Betracht ziehen. Wir sind bestrebt, solche Verbesserungen durch die Umsetzung der Mitwirkungspolitik zu fördern.
- Ausschluss von Unternehmen, die gegen anerkannte internationale Standards und Prinzipien wie den „United Nations Global Compact“ (Global Pakt der Vereinten Nationen) und die „United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights“ (UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte) verstoßen
- Ausschluss von Unternehmen, die gemäß der „Columbia Threadneedle Controversial Weapons Policy“ an kontroversen Waffen beteiligt sind, und von Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen
- Zur Unterstützung der Bewerbung von ökologischen und sozialen Merkmalen gehen wir auf Unternehmen zu und wirken bei den Managementteams auf die Verbesserung hin, zum Beispiel bei Fragen im Zusammenhang mit CO₂-Emissionen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Das Finanzprodukt weist folgende Nachhaltigkeitsindikatoren auf:

- Der primäre Indikator ist das positive gewichtete durchschnittliche „ESG Materiality Rating“ des Portfolios im Vergleich zum „MSCI Europe (Gross TR) Index“, bewertet über rollierende 12-monatige Zeiträume. Das positive „ESG Materiality Rating“ gegenüber dem Index wurde täglich von unseren Compliance-Systemen überwacht. Das Portfolio wies während des Berichtszeitraums ein besseres „ESG Materiality Rating“ auf als die Benchmark.
Am 31. März 2023 lag das Rating des Portfolios bei 2,70 und das Benchmarkrating bei 2,79 (auf einer Skala von 1 bis 5, je niedriger, desto besser).
- Wir investierten mindestens 80 % des Portfolios in Unternehmen mit starken oder sich verbessernden ESG-Merkmalen, gemessen anhand einer Kombination aus Rating „ESG Materiality“ und Fundamentaldatenanalyse der Unternehmen.
- Wir schlossen Unternehmen aus, die unserer Ansicht nach gegen anerkannte internationale Standards verstoßen haben, zum Beispiel gegen die „UN Global Compact Principles“. Die Einhaltung der Ausschlusspolitik wurde durch die Anwendung strenger Vorhandelsbeschränkungen gewährleistet und kontinuierlich überwacht.
- Zudem hielten wir die „Controversial Weapons Policy“ ein und schlossen Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen aus.

Bei den **wesentlichen 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.

Da diese Indikatoren die Grundlage für die vom Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bilden, sind die Indikatoren auch die verbindlichen Elemente der ESG-Strategie des Portfolios.

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

Eine Gegenüberstellung der Nachhaltigkeitsindikatoren zu einem vergangenen Zeitraum werden wir im nächsten Bericht vorlegen.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

— *Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den „OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen“ und den „UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte“ in Einklang? Nähere Angaben:*

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

In der EU-Taxonomie ist das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ 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.

Auch alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele nicht erheblich beeinträchtigen.



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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.



Was waren die wesentlichen Investitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst diejenigen Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden.

Größte Investitionen	Wirtschaftszweig	Durchschnittliche Gewichtung	Land
NOVO NORDISK CLASS B	Gesundheitswesen	4,01 %	Dänemark
ASML HOLDING NV	Informationstechnologie	3,84 %	Niederlande
LVMH	Nicht-Basiskonsumgüter	3,82 %	Frankreich
NESTLE SA	Basiskonsumgüter	3,73 %	Schweiz
ROCHE HOLDING PAR AG	Gesundheitswesen	3,70 %	Vereinigte Staaten
ASTRAZENECA PLC	Gesundheitswesen	3,38 %	Vereinigtes Königreich
TOTALENERGIES	Energie	3,15 %	Frankreich
LOREAL SA	Basiskonsumgüter	2,90 %	Frankreich
ASHTAD GROUP PLC	Industriegüter	2,29 %	Vereinigtes Königreich
UBS GROUP AG	Finanzen	2,28 %	Schweiz
CRH PLC	Roh- und Grundstoffe	2,18 %	Irland
SIKA AG	Roh- und Grundstoffe	2,12 %	Schweiz
3I GROUP PLC	Finanzen	2,10 %	Vereinigtes Königreich
VODAFONE GROUP PLC	Kommunikationsdienstleistungen	2,07 %	Vereinigtes Königreich
RIO TINTO PLC	Roh- und Grundstoffe	2,00 %	Vereinigtes Königreich

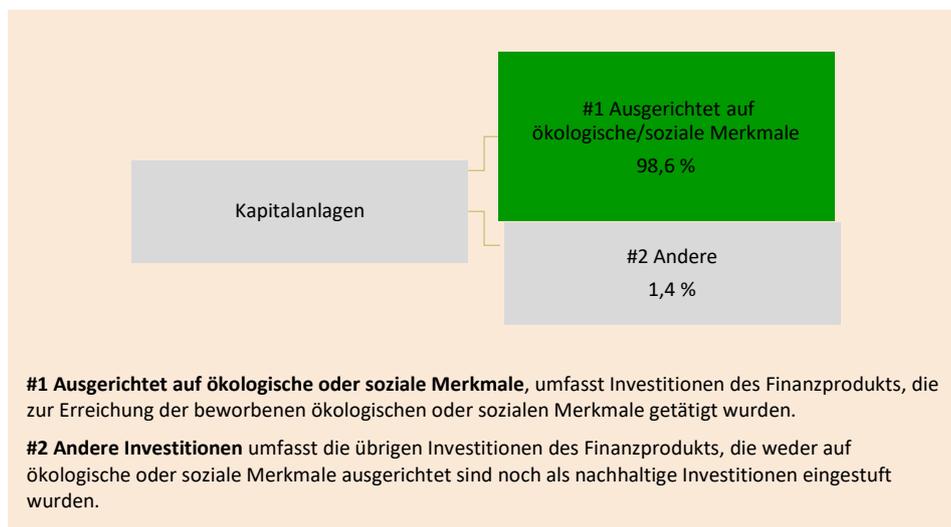


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

98,6 % des Portfolios waren in Unternehmen mit starken oder sich verbessernden ESG-Merkmalen investiert, gemessen an einer Kombination aus „ESG Materiality Rating“ und Fundamentaldatenanalyse der Unternehmen im Portfolio.

1,4 % der Investitionen umfassen die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, noch als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden.



● In welchen Wirtschaftszweigen wurden die Investitionen getätigt?

Wirtschaftszweig	Durchschnittliche Gewichtung
Kommunikationsdienstleistungen	3,7 %
Nicht-Basiskonsumgüter	13,5 %
Basiskonsumgüter	9,2 %
Energie	3,4 %
Finanzen	18,3 %
Gesundheitswesen	14,3 %
Industriegüter	18,0 %
Informationstechnologie	7,3 %
Roh- und Grundstoffe	9,7 %
Versorgungsunternehmen	1,3 %
Barmittel	1,4 %

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

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

Ermöglichende Tätigkeiten ermöglichen unmittelbar, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel leisten.

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



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

Der Fonds ist nicht verpflichtet, die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung zu erfüllen.

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in mit der EU-Taxonomie konforme Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ investiert¹?**

Ja:

In fossiles Gas In Kernenergie

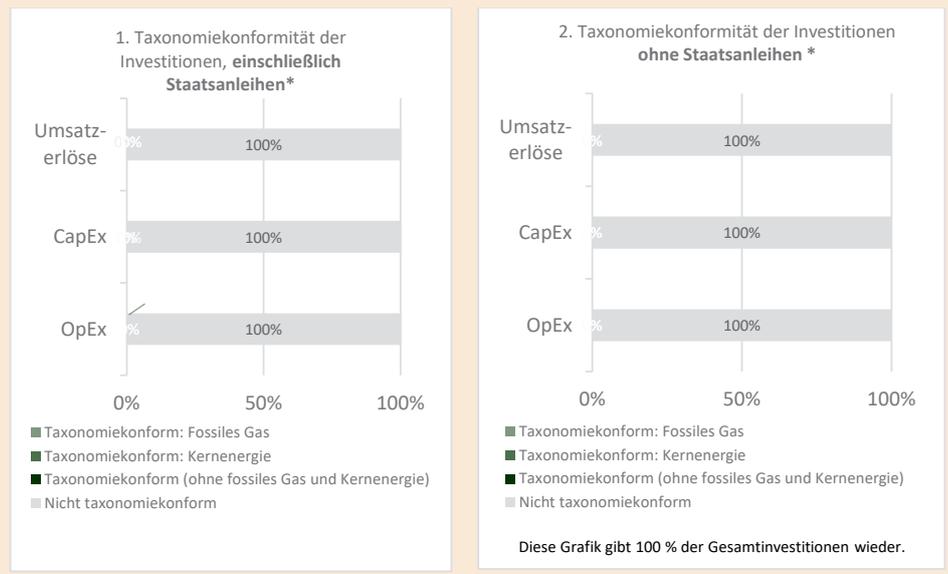
Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ sind nur dann mit der EU-Taxonomie konform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links. Die vollständigen Kriterien für mit der EU-Taxonomie konforme Wirtschaftstätigkeiten in den Bereichen „Fossiles Gas“ und „Kernenergie“ sind der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission zu entnehmen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

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



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

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?**

0 % der vom Fonds getätigten Kapitalanlagen befinden sich in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung.

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

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden. Der Fonds hat noch keine Angleichung an die EU-Taxonomieverordnung gemeldet.

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

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren, deren Umweltziel nicht mit der EU-Taxonomieverordnung im Einklang steht.

 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?

- Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel zu investieren.



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

Zu den als „Andere“ eingestufteten Beteiligungen gehören (i) zusätzliche liquide Mittel (d. h. Sichteinlagen bei einer Bank), die zum Zwecke des Liquiditätsmanagements gehalten werden, (ii) Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente oder Geldmarktfonds, die zu steuerlichen Zwecken gehalten werden, oder (iii) Derivate zu Absicherungszwecken.

Mindestschutz zu Umwelt oder Sozialem für Barpositionen und Derivate sind in die Bewertung des ESG-Kontrahentenrisikos integriert.



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

Wir führten Gespräche mit Unternehmen, mit dem Ziel, ihre Herangehensweise in Bezug auf ESG-Risiken und ESG-Praktiken zu beeinflussen.

Im Berichtszeitraum haben wir uns beispielsweise mit ASM International in Verbindung gesetzt und Themen zu Unternehmensführung und Einbeziehung von ESG-Metriken in die Vergütung von Führungskräften besprochen. Dadurch wird die Übernahme von Verantwortung durch Führungskräfte gefördert. Nach unserem Engagement stimmte das Unternehmen der Umsetzung zu. Darüber hinaus hat das Unternehmen nach Engagements im Jahr 2022 die Diversität am Arbeitsplatz gesteigert und zukünftige Ziele bei der geschlechterverteilten Neueinstellung festgelegt. Schließlich hat das Unternehmen das Emissionsziel in Übereinstimmung mit dem globalen „1.5C-Pathway“ festgelegt.

Zudem haben wir mit Nestle über Ernährungsstrategien gesprochen. Das Unternehmen unterstrich sein Ziel, führend im Vertrieb gesunder Lebensmittel zu sein. Wir äußerten Bedenken, dass Nestle, im Gegensatz zu seinen Mitbewerbern, keine konkreten Ziele formuliert hat. Wir brachten vor, dass alle Ziele, welche auch immer, eine starke Botschaft an die gesamte Branche senden würden. Wir werden uns weiterhin auf dieses Thema konzentrieren.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie unterscheidet sich die Referenzbenchmark von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **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?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

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

Während des Berichtszeitraums wies das Finanzprodukt ein hervorragendes ESG-Profil gegenüber dem „MSCI Europe (Gross TR) Index“ auf, gemessen am Modell „Columbia Threadneedle Investments ESG Materiality Rating“.

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: Threadneedle (Lux) Pan European Smaller Companies

Rechtsträgerkennung (LEI, Legal Entity Identifier): 549300FG0S32L53EKJ87

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt? *[Bitte gegebenenfalls ankreuzen und ausfüllen; der Prozentsatz entspricht den nachhaltigen Investitionen.]*

●● <input type="checkbox"/> Ja	●○ <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Mit diesem Finanzprodukt wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : ___ %	<input type="checkbox"/> Das Finanzprodukt bewarb ökologische und soziale Merkmale und Obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt das Finanzprodukt ___ % an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind	<input type="checkbox"/> Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind
<input type="checkbox"/> In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind	<input type="checkbox"/> Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind
<input type="checkbox"/> Mit dem Finanzprodukt wurden nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___ %	<input type="checkbox"/> Mit einem sozialen Ziel
	<input checked="" type="checkbox"/> Mit dem Finanzprodukt wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Kapitalanlage in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines 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 in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel können taxonomiekonform sein oder auch nicht.



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

Anhand von **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden.

Das Finanzprodukt bewirbt ökologische und soziale Merkmale, indem es die folgenden Maßnahmen eines verantwortungsbewussten Investments in den Entscheidungsprozess für Kapitalanlagen beinhaltet:

- Übertreffen des Verzeichnisses grundlegender ESG-Kriterien, gemessen anhand des Modells „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ über rollierende 12-monatige Zeiträume

- Beibehaltung von mindestens 50 % an Portfoliobeständen an Unternehmen, die ein Rating von 1 bis 3 beim „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ aufweisen. Bei Notwendigkeit durch Bewertung von Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder durch Zusammenarbeit mit Unternehmen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird.
- Ausschluss von Unternehmen, die gegen anerkannte internationale Standards und Prinzipien wie den „United Nations Global Compact“ (Global Pakt der Vereinten Nationen) und die „United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights“ (UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte) verstoßen
- Ausschluss von Unternehmen, die gemäß der „Columbia Threadneedle Controversial Weapons Policy“ an kontroversen Waffen beteiligt sind, und von Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen
- Zur Unterstützung der Bewerbung von ökologischen und sozialen Merkmalen gehen wir auf Unternehmen zu und wirken bei den Managementteams auf die Verbesserung hin, zum Beispiel bei Fragen im Zusammenhang mit CO₂-Emissionen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Das Finanzprodukt weist folgende Nachhaltigkeitsindikatoren auf:

- Der primäre Indikator ist das positive gewichtete durchschnittliche „ESG Materiality Rating“ des Portfolios im Vergleich zum „EMIX Smaller Europe (inc UK) Index“, bewertet über rollierende 12-monatige Zeiträume. Das positive „ESG Materiality Rating“ gegenüber dem Index wurde täglich von unseren Compliance-Systemen überwacht. Das Portfolio wies während des Berichtszeitraums ein besseres „ESG Materiality Rating“ auf als die Benchmark.
Am 31. März 2023 lag das Rating des Portfolios bei 2,76 und das Benchmarkrating bei 2,97 (auf einer Skala von 1 bis 5, je niedriger, desto besser).
- Wir investierten mindestens 50 % des Portfolios in Unternehmen mit einem starken „ESG Materiality Rating“. Bei Notwendigkeit bewerten wir Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder wir arbeiten mit Unternehmen zusammen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird. Das Finanzprodukt behielt im Berichtszeitraum seine Beteiligungen von über 50 % an Unternehmen mit einem Rating von 1 bis 3 bei.
- Wir schlossen Unternehmen aus, die unserer Ansicht nach gegen anerkannte internationale Standards verstoßen haben, zum Beispiel gegen die „UN Global Compact Principals“. Die Einhaltung der Ausschlusspolitik wurde durch die Anwendung strenger Verhandelsbeschränkungen gewährleistet und kontinuierlich überwacht.
- Zudem hielten wir die „Controversial Weapons Policy“ ein und schlossen Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen aus.

Da diese Indikatoren die Grundlage für die vom Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bilden, sind die Indikatoren auch die verbindlichen Elemente der ESG-Strategie des Portfolios.

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

Eine Gegenüberstellung der Nachhaltigkeitsindikatoren zu einem vergangenen Zeitraum werden wir im nächsten Bericht vorlegen.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den „OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen“ und den „UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte“ in Einklang? Nähere Angaben:

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

In der EU-Taxonomie ist das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ 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.

Auch alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele nicht erheblich beeinträchtigen.

Bei den wesentlichen 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 wesentlichsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.



Was waren die wesentlichen Investitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst diejenigen Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden.

Größte Investitionen	Wirtschaftszweig	Durchschnittliche Gewichtung	Land
SIG GROUP N AG	Roh- und Grundstoffe	2,60 %	Schweiz
CVS GROUP PLC	Gesundheitswesen	2,50 %	Vereinigtes Königreich
CTS EVENTIM AG	Kommunikationsdienstleistungen	2,41 %	Deutschland
WATCHES OF SWITZERLAND GROUP PLC	Nicht-Basiskonsumgüter	2,20 %	Vereinigtes Königreich
EUROFINS SCIENTIFIC	Gesundheitswesen	2,09 %	Luxemburg
FINECOBANK BANCA FINECO	Finanzen	2,08 %	Italien
GENUS PLC	Gesundheitswesen	2,06 %	Vereinigtes Königreich
AVANZA BANK HOLDING	Finanzen	2,05 %	Schweden
ST. JAMES PLACE PLC	Finanzen	2,04 %	Vereinigtes Königreich
HOWDEN JOINERY GROUP PLC	Industriegüter	2,01 %	Vereinigtes Königreich
BIG YELLOW GROUP PLC	Immobilien	2,00 %	Vereinigtes Königreich
COMPUGROUP MEDICAL N	Gesundheitswesen	1,97 %	Deutschland
BELIMO N AG	Industriegüter	1,96 %	Schweiz
FLUIDRA SA	Industriegüter	1,94 %	Spanien
ASM INTERNATIONAL NV	Informationstechnologie	1,88 %	Niederlande



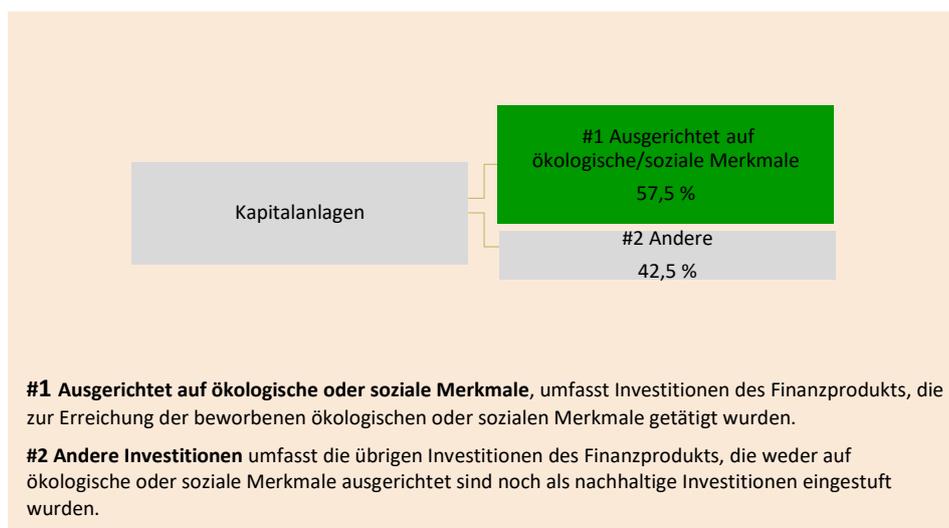
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

57,5 % des Finanzprodukts waren in Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 1 bis 3 investiert und somit auf ökologische/soziale Merkmale ausgerichtet.

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

42,5 % des Finanzprodukts waren investiert in: (1) Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, die daher nicht mit ökologischen/sozialen Merkmalen in Einklang standen, (2) Unternehmen, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen, und (3) Barmittel und Derivate.



In welchen Wirtschaftszweigen wurden die Investitionen getätigt?

Wirtschaftszweig	Durchschnittliche Gewichtung
Industriegüter	20,71 %
Gesundheitswesen	18,02 %
Informationstechnologie	14,10 %
Finanzen	12,31 %
Nicht-Basiskonsumgüter	10,49 %
Roh- und Grundstoffe	9,52 %
Kommunikationsdienstleistungen	8,19 %
Basiskonsumgüter	3,38 %
Immobilien	2,65 %
Energie	0,08 %
Barmittel	0,56 %



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

Der Fonds ist nicht verpflichtet, die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung zu erfüllen.

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

Ermöglichende Tätigkeiten ermöglichen unmittelbar, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel leisten.

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

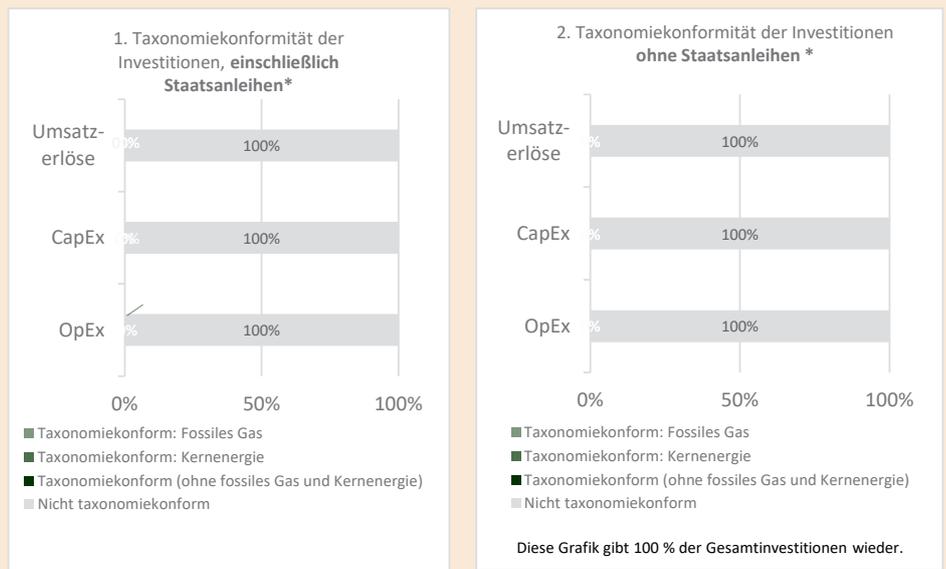
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in mit der EU-Taxonomie konforme Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ investiert¹?**

- Ja:
 - In fossiles Gas
 - In Kernenergie
- Nein

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



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

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?**

0 % der vom Fonds getätigten Kapitalanlagen befinden sich in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung.

¹ Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ sind nur dann mit der EU-Taxonomie konform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links. Die vollständigen Kriterien für mit der EU-Taxonomie konforme Wirtschaftstätigkeiten in den Bereichen „Fossiles Gas“ und „Kernenergie“ sind der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission zu entnehmen.

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

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden. Der Fonds hat noch keine Angleichung an die EU-Taxonomieverordnung gemeldet.



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

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren, deren Umweltziel nicht mit der EU-Taxonomieverordnung im Einklang steht.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel zu investieren.



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

Zu den als „Andere“ eingestuften Beteiligungen gehören (i) zusätzliche liquide Mittel (d. h. Sichteinlagen bei einer Bank), die zum Zwecke des Liquiditätsmanagements gehalten werden, (ii) Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente oder Geldmarktfonds, die zu steuerlichen Zwecken gehalten werden, oder (iii) Derivate zu Absicherungszwecken, (iv) Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, oder (v) Unternehmen, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen.

Diese Investitionen werden nicht zum Erfüllen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios genutzt. Der Zweck dieser Wertpapiere besteht darin, ein diversifiziertes Portfolio zu erreichen, das die finanzielle Zielstellung erreichen kann.

Mindestschutz zu Umwelt oder Sozialem wird durch Ausschluss-Screening aller Beteiligungen an Unternehmen, in die investiert wird, gewährleistet. Bei Barpositionen und Derivaten sind ESG-Erwägungen in die Bewertung des Kontrahentenrisikos integriert.



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

Wir führten Gespräche mit Unternehmen, mit dem Ziel, ihre Herangehensweise in Bezug auf ESG-Risiken und ESG-Praktiken zu beeinflussen.

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

Im Berichtszeitraum haben wir uns beispielsweise mit ASM International in Verbindung gesetzt und Themen zu Unternehmensführung und Einbeziehung von ESG-Metriken in die Vergütung von Führungskräften besprochen. Dadurch wird die Übernahme von Verantwortung durch Führungskräfte gefördert. Nach unserem Engagement stimmte das Unternehmen der Umsetzung zu. Darüber hinaus hat das Unternehmen nach Engagements im Jahr 2022 die Diversität am Arbeitsplatz gesteigert und zukünftige Ziele bei der geschlechterverteilten Neueinstellung festgelegt. Schließlich hat das Unternehmen das Emissionsziel in Übereinstimmung mit dem globalen „1.5C-Pathway“ festgelegt.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie unterscheidet sich die Referenzbenchmark von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **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?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

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

Während des Berichtszeitraums wies das Finanzprodukt ein hervorragendes ESG-Profil gegenüber dem „EMIX Smaller Europe (inc UK) Index“ auf, gemessen am Modell „Columbia Threadneedle Investments ESG Materiality Rating“.

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: Threadneedle (Lux) European Select

Rechtsträgerkennung (LEI, Legal Entity Identifier): 549300MKHX2X26Q8CM51

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● <input type="checkbox"/> Ja	●● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Mit diesem Finanzprodukt wurden 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 qualifiziert sind <input type="checkbox"/> In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind 	<input type="checkbox"/> Das Finanzprodukt bewarb ökologische und soziale Merkmale und Obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt das Finanzprodukt ___ % 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 qualifiziert sind <input type="checkbox"/> Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind <input type="checkbox"/> Mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Mit dem Finanzprodukt wurden nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___ %	<input checked="" type="checkbox"/> Mit dem Finanzprodukt wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Kapitalanlage in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines 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 in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel können taxonomiekonform sein oder auch nicht.



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

Anhand von **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden.

Das Finanzprodukt bewirbt ökologische und soziale Merkmale, indem es die folgenden Maßnahmen eines verantwortungsbewussten Investments in den Entscheidungsprozess für Kapitalanlagen beinhaltet:

- Übertreffen des Verzeichnisses grundlegender ESG-Kriterien, gemessen anhand des Modells „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ über rollierende 12-monatige Zeiträume
- Beibehaltung von mindestens 50 % an Portfoliobeständen an Unternehmen, die ein Rating von 1 bis 3 beim „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ aufweisen. Bei Notwendigkeit durch Bewertung von Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder durch Zusammenarbeit mit Unternehmen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird.
- Ausschluss von Unternehmen, die gegen anerkannte internationale Standards und Prinzipien wie den „United Nations Global Compact“ (Global Pakt der Vereinten Nationen) und die „United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights“ (UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte) verstoßen
- Ausschluss von Unternehmen, die gemäß der „Columbia Threadneedle Controversial Weapons Policy“ an kontroversen Waffen beteiligt sind, und von Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen
- Zur Unterstützung der Bewertung von ökologischen und sozialen Merkmalen gehen wir auf Unternehmen zu und wirken bei den Managementteams auf die Verbesserung hin, zum Beispiel bei Fragen im Zusammenhang mit CO₂-Emissionen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Das Finanzprodukt weist folgende Nachhaltigkeitsindikatoren auf:

- Der primäre Indikator ist das positive gewichtete durchschnittliche „ESG Materiality Rating“ des Portfolios im Vergleich zum „FTSE World Europe ex UK Index“, bewertet über rollierende 12-monatige Zeiträume. Das positive „ESG Materiality Rating“ gegenüber dem Index wurde täglich von unseren Compliance-Systemen überwacht. Das Portfolio wies während des Berichtszeitraums ein besseres „ESG Materiality Rating“ auf als die Benchmark. Am 31. März 2023 lag das Rating des Portfolios bei 2,34 und das Benchmarkrating bei 2,73 (auf einer Skala von 1 bis 5, je niedriger, desto besser).
- Wir investierten mindestens 50 % des Portfolios in Unternehmen mit einem starken „ESG Materiality Rating“. Bei Notwendigkeit bewerten wir Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder wir arbeiten mit Unternehmen zusammen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird. Das Finanzprodukt behielt im Berichtszeitraum seine Beteiligungen von über 50 % an Unternehmen mit einem Rating von 1 bis 3 bei.
- Wir schlossen Unternehmen aus, die unserer Ansicht nach gegen anerkannte internationale Standards verstoßen haben, zum Beispiel gegen die „UN Global Compact Principals“. Die Einhaltung der Ausschlusspolitik wurde durch die Anwendung strenger Verhandelsbeschränkungen gewährleistet und kontinuierlich überwacht.
- Zudem hielten wir die „Controversial Weapons Policy“ ein und schlossen Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen aus.

Da diese Indikatoren die Grundlage für die vom Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bilden, sind die Indikatoren auch die verbindlichen Elemente der ESG-Strategie des Portfolios.

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

Eine Gegenüberstellung der Nachhaltigkeitsindikatoren zu einem vergangenen Zeitraum werden wir im nächsten Bericht vorlegen.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den „OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen“ und den „UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte“ in Einklang? Nähere Angaben:

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

In der EU-Taxonomie ist das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ 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.

Auch alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele nicht erheblich beeinträchtigen.

Bei den **wesentlichen 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?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.



Was waren die wesentlichen Investitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst diejenigen Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden.

Größte Investitionen	Wirtschaftszweig	Durchschnittliche Gewichtung	Land
NESTLE SA	Basiskonsumgüter	6,22 %	Schweiz
ASML HOLDING NV	Informationstechnologie	5,42 %	Niederlande
LVMH	Nicht-Basiskonsumgüter	5,41 %	Frankreich
SCHNEIDER ELECTRIC	Industriegüter	4,49 %	Frankreich
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL INDITEX	Nicht-Basiskonsumgüter	4,28 %	Spanien
LOREAL SA	Basiskonsumgüter	4,01 %	Frankreich
TRYG	Finanzen	3,90 %	Dänemark
NOVO NORDISK CLASS B	Gesundheitswesen	3,82 %	Dänemark
BRENNTAG	Industriegüter	3,81 %	Deutschland
LONZA GROUP AG	Gesundheitswesen	3,72 %	Schweiz
SAP	Informationstechnologie	3,65 %	Deutschland
PERNOD RICARD SA	Basiskonsumgüter	3,55 %	Frankreich
DAVIDE CAMPARI MILANO NV	Basiskonsumgüter	3,42 %	Italien
SIKA AG	Roh- und Grundstoffe	3,17 %	Schweiz
IMCD NV	Industriegüter	2,77 %	Niederlande

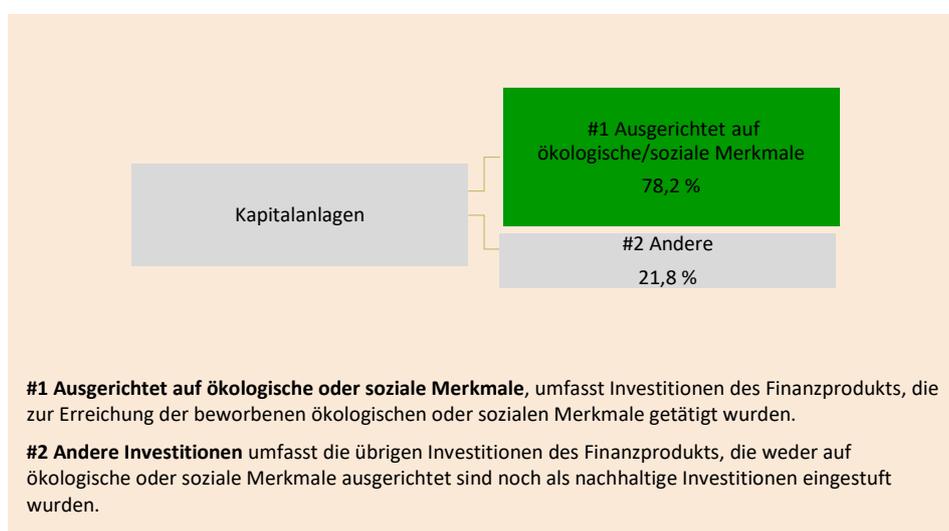


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

78,2 % des Finanzprodukts waren in Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 1 bis 3 investiert und somit auf ökologische/soziale Merkmale ausgerichtet.

21,8 % des Finanzprodukts waren investiert in: (1) Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, die daher nicht mit ökologischen/sozialen Merkmalen in Einklang standen, (2) Unternehmen, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen, und (3) Barmittel und Derivate.



● In welchen Wirtschaftszweigen wurden die Investitionen getätigt?

Wirtschaftszweig	Durchschnittliche Gewichtung
Industriegüter	22,26 %
Basiskonsumgüter	17,21 %
Nicht-Basiskonsumgüter	16,75 %
Informationstechnologie	12,77 %
Finanzen	12,13 %
Gesundheitswesen	10,80 %
Roh- und Grundstoffe	6,03 %
Barmittel	2,04 %

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

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

Ermöglichende Tätigkeiten ermöglichen unmittelbar, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel leisten.

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



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

Der Fonds ist nicht verpflichtet, die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung zu erfüllen.

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden.

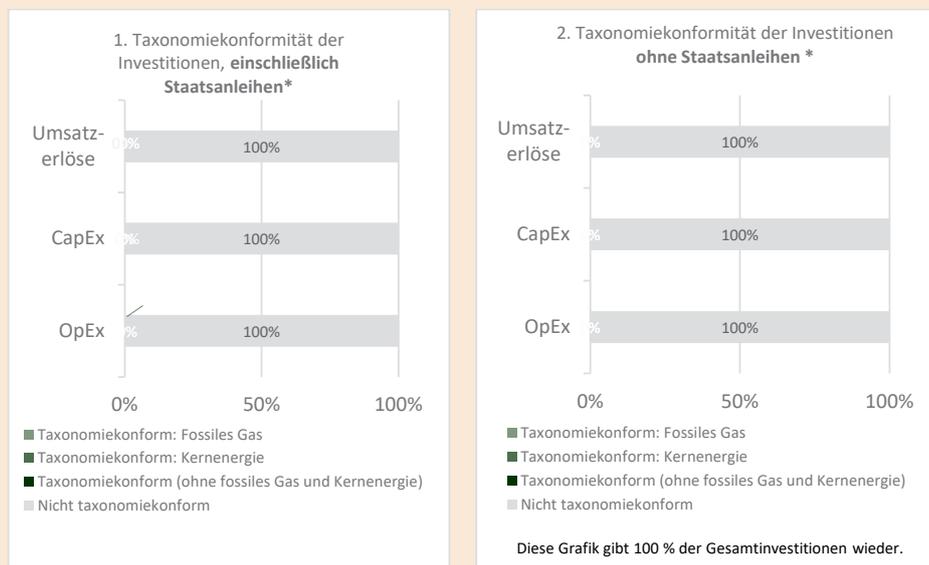
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in mit der EU-Taxonomie konforme Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ investiert¹?



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



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

¹ Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ sind nur dann mit der EU-Taxonomie konform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links. Die vollständigen Kriterien für mit der EU-Taxonomie konforme Wirtschaftstätigkeiten in den Bereichen „Fossiles Gas“ und „Kernenergie“ sind der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission zu entnehmen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?**

0 % der vom Fonds getätigten Kapitalanlagen befinden sich in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung.

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

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden. Der Fonds hat noch keine Angleichung an die EU-Taxonomieverordnung gemeldet.



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

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren, deren Umweltziel nicht mit der EU-Taxonomieverordnung im Einklang steht.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel zu investieren.



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

Zu den als „Andere“ eingestufteten Beteiligungen gehören (i) zusätzliche liquide Mittel (d. h. Sichteinlagen bei einer Bank), die zum Zwecke des Liquiditätsmanagements gehalten werden, (ii) Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente oder Geldmarktfonds, die zu steuerlichen Zwecken gehalten werden, oder (iii) Derivate zu Absicherungszwecken, (iv) Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, oder (v) Unternehmen, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen.

Diese Investitionen werden nicht zum Erfüllen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios genutzt. Der Zweck dieser Wertpapiere besteht darin, ein diversifiziertes Portfolio zu erreichen, das die finanzielle Zielstellung erreichen kann.

Mindestschutz zu Umwelt oder Sozialem wird durch Ausschluss-Screening aller Beteiligungen an Unternehmen, in die investiert wird, gewährleistet. Bei Barpositionen und Derivaten sind ESG-Erwägungen in die Bewertung des Kontrahentenrisikos integriert.



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



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

Wir führten Gespräche mit Unternehmen, mit dem Ziel, ihre Herangehensweise in Bezug auf ESG-Risiken und ESG-Praktiken zu beeinflussen.

Im Berichtszeitraum haben wir uns beispielsweise mit ASM International in Verbindung gesetzt und Themen zu Unternehmensführung und Einbeziehung von ESG-Metriken in die Vergütung von Führungskräften besprochen. Dadurch wird die Übernahme von Verantwortung durch Führungskräfte gefördert. Nach unserem Engagement stimmte das Unternehmen der Umsetzung zu. Darüber hinaus hat das Unternehmen nach Engagements im Jahr 2022 die Diversität am Arbeitsplatz gesteigert und zukünftige Ziele bei der geschlechterverteilten Neueinstellung festgelegt. Schließlich hat das Unternehmen das Emissionsziel in Übereinstimmung mit dem globalen „1.5C-Pathway“ festgelegt.

Zudem haben wir mit Nestle über Ernährungsstrategien gesprochen. Das Unternehmen unterstrich sein Ziel, führend im Vertrieb gesunder Lebensmittel zu sein. Wir äußerten Bedenken, dass Nestle, im Gegensatz zu seinen Mitbewerbern, keine konkreten Ziele formuliert hat. Wir brachten vor, dass alle Ziele, welche auch immer, eine starke Botschaft an die gesamte Branche senden würden. Wir werden weiterhin in diese Richtung wirken.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie unterscheidet sich die Referenzbenchmark von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **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?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

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

Während des Berichtszeitraums wies das Finanzprodukt ein hervorragendes ESG-Profil gegenüber dem „FTSE World Europe ex UK Index“ auf, gemessen am Modell „Columbia Threadneedle Investments ESG Materiality Rating“.

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: Threadneedle (Lux) European Smaller Companies

Rechtsträgerkennung (LEI, Legal Entity Identifier): 54930003VV6JZQNNIC16

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Mit diesem Finanzprodukt wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt**: ___ %

In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind

In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind

Mit dem Finanzprodukt wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___ %

Nein

Das Finanzprodukt **bewarb ökologische und soziale Merkmale** und Obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt das Finanzprodukt ___ % an nachhaltigen Investitionen

Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind

Mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig qualifiziert sind

Mit einem sozialen Ziel

Mit dem Finanzprodukt wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Kapitalanlage in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines 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 in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel können taxonomiekonform sein oder auch nicht.



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

Das Finanzprodukt bewirbt ökologische und soziale Merkmale, indem es die folgenden Maßnahmen eines verantwortungsbewussten Investments in den Entscheidungsprozess für Kapitalanlagen beinhaltet:

Anhand von **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden.

- Übertreffen des Verzeichnisses grundlegender ESG-Kriterien, gemessen anhand des Modells „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ über rollierende 12-monatige Zeiträume
- Beibehaltung von mindestens 50 % an Portfoliobeständen an Unternehmen, die ein Rating von 1 bis 3 beim „Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating“ aufweisen. Bei Notwendigkeit durch Bewertung von Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder durch Zusammenarbeit mit Unternehmen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird.
- Ausschluss von Unternehmen, die gegen anerkannte internationale Standards und Prinzipien wie den „United Nations Global Compact“ (Global Pakt der Vereinten Nationen) und die „United Nations Guiding Principles on Business and Human Rights“ (UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte) verstoßen
- Ausschluss von Unternehmen, die gemäß der „Columbia Threadneedle Controversial Weapons Policy“ an kontroversen Waffen beteiligt sind, und von Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen
- Zur Unterstützung der Bewertung von ökologischen und sozialen Merkmalen gehen wir auf Unternehmen zu und wirken bei den Managementteams auf die Verbesserung hin, zum Beispiel bei Fragen im Zusammenhang mit CO₂-Emissionen.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Das Finanzprodukt weist folgende Nachhaltigkeitsindikatoren auf:

- Der primäre Indikator ist das positive gewichtete durchschnittliche „ESG Materiality Rating“ des Portfolios im Vergleich zum „Euromoney Small Europe ex-UK Index“, bewertet über rollierende 12-monatige Zeiträume. Das positive „ESG Materiality Rating“ gegenüber dem Index wurde täglich von unseren Compliance-Systemen überwacht. Das Portfolio wies während des Berichtszeitraums ein besseres „ESG Materiality Rating“ auf als die Benchmark. Am 31. März 2023 lag das Rating des Portfolios bei 2,89 und das Benchmarkrating bei 2,86 (auf einer Skala von 1 bis 5, je niedriger, desto besser).
- Wir investierten mindestens 50 % des Portfolios in Unternehmen mit einem starken „ESG Materiality Rating“. Bei Notwendigkeit bewerten wir Unternehmen, die nicht durch das „ESG Materiality Rating Model“ abgedeckt sind, mithilfe von Fundamentaldatenanalysen oder wir arbeiten mit Unternehmen zusammen, die ein niedriges „ESG Materiality Rating“ aufweisen, zwecks Verbesserung dieses Ratings, damit dieses Mindestengagement von 50 % erreicht wird. Das Finanzprodukt behielt im Berichtszeitraum seine Beteiligungen von über 50 % an Unternehmen mit einem Rating von 1 bis 3 bei.
- Wir schlossen Unternehmen aus, die unserer Ansicht nach gegen anerkannte internationale Standards verstoßen haben, zum Beispiel gegen die „UN Global Compact Principals“. Die Einhaltung der Ausschlusspolitik wurde durch die Anwendung strenger Vorhandelsbeschränkungen gewährleistet und kontinuierlich überwacht.
- Zudem hielten wir die „Controversial Weapons Policy“ ein und schlossen Unternehmen mit direkter Beteiligung an Atomwaffen aus.

Da diese Indikatoren die Grundlage für die vom Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale bilden, sind die Indikatoren auch die verbindlichen Elemente der ESG-Strategie des Portfolios.

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

Eine Gegenüberstellung der Nachhaltigkeitsindikatoren zu einem vergangenen Zeitraum werden wir im nächsten Bericht vorlegen.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den „OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen“ und den „UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte“ in Einklang? Nähere Angaben:

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren.

In der EU-Taxonomie ist das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Das Prinzip „keinen erheblichen Schaden verursachen“ 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.

Auch alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele nicht erheblich beeinträchtigen.

Bei den wesentlichen 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?

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt verpflichtet sich nicht, die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.



Was waren die wesentlichen Investitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst diejenigen Investitionen, auf die **der größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigt wurden.

Größte Investitionen	Wirtschaftszweig	Durchschnittliche Gewichtung	Land
CTS EVENTIM AG	Kommunikationsdienstleistungen	2,66 %	Deutschland
SIG GROUP N AG	Roh- und Grundstoffe	2,66 %	Schweiz
MELEXIS NV	Informationstechnologie	2,63 %	Belgien
ASM INTERNATIONAL NV	Informationstechnologie	2,53 %	Niederlande
IMCD NV	Industriegüter	2,51 %	Niederlande
BELIMO N AG	Industriegüter	2,51 %	Schweiz
BUREAU VERITAS SA	Industriegüter	2,47 %	Frankreich
TRYG	Finanzen	2,40 %	Dänemark
FINECOBANK BANCA FINECO	Finanzen	2,38 %	Italien
VAT GROUP AG	Industriegüter	2,18 %	Schweiz
SIKA AG	Roh- und Grundstoffe	2,10 %	Schweiz
BRENNTAG	Industriegüter	2,03 %	Deutschland
BURCKHARDT COMPRESSION HOLDING AG	Industriegüter	2,01 %	Schweiz
AVANZA BANK HOLDING	Finanzen	1,97 %	Schweden
HUHTAMAKI	Roh- und Grundstoffe	1,92 %	Finnland



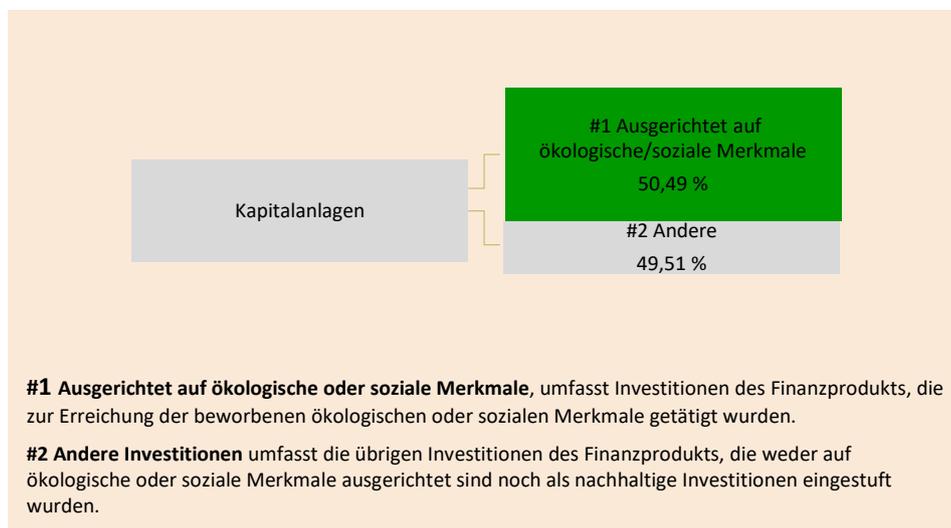
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

50,49 % des Finanzprodukts waren in Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 1 bis 3 investiert und somit auf ökologische/soziale Merkmale ausgerichtet.

49,51 % des Finanzprodukts waren investiert in: (1) Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, die daher nicht mit ökologischen/sozialen Merkmalen in Einklang standen, (2) Unternehmen, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen, und (3) Barmittel und Derivate.

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



● **In welchen Wirtschaftszweigen wurden die Investitionen getätigt?**

Wirtschaftszweig	Durchschnittliche Gewichtung
Industriegüter	27,74 %
Informationstechnologie	16,61 %
Gesundheitswesen	15,91 %
Finanzen	11,91 %
Roh- und Grundstoffe	10,09 %
Basiskonsumgüter	5,97 %
Kommunikationsdienstleistungen	5,34 %
Nicht-Basiskonsumgüter	4,68 %
Immobilien	0,26 %
Energie	0,09 %
Barmittel	1,40 %

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

Ermöglichende Tätigkeiten ermöglichen unmittelbar, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu einem Umweltziel leisten.

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

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



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

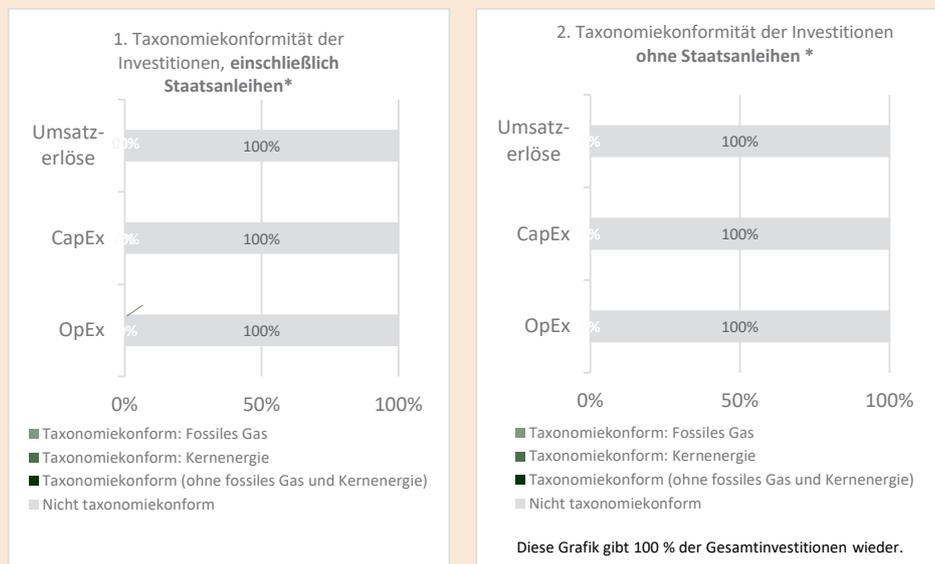
Der Fonds ist nicht verpflichtet, die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung zu erfüllen.

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden.

● Wurde mit dem Finanzprodukt in mit der EU-Taxonomie konforme Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ investiert¹?



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



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

¹ Tätigkeiten im Bereich „Fossiles Gas“ und/oder „Kernenergie“ sind nur dann mit der EU-Taxonomie konform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links. Die vollständigen Kriterien für mit der EU-Taxonomie konforme Wirtschaftstätigkeiten in den Bereichen „Fossiles Gas“ und „Kernenergie“ sind der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission zu entnehmen.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?**

0 % der vom Fonds getätigten Kapitalanlagen befinden sich in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung.

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

Auf der Grundlage zuverlässiger Daten, die bisher zur Verfügung gestellt wurden, berichtet der Fonds, dass 0 % seiner Kapitalanlagen in Wirtschaftstätigkeiten getätigt werden, die gemäß der EU-Taxonomieverordnung als „ökologisch nachhaltig“ qualifiziert werden. Der Fonds hat noch keine Angleichung an die EU-Taxonomieverordnung gemeldet.



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

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen zu investieren, deren Umweltziel nicht mit der EU-Taxonomieverordnung im Einklang steht.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend – der Fonds verpflichtet sich nicht, in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel zu investieren.



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

Zu den als „Andere“ eingestuften Beteiligungen gehören (i) zusätzliche liquide Mittel (d. h. Sichteinlagen bei einer Bank), die zum Zwecke des Liquiditätsmanagements gehalten werden, (ii) Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente oder Geldmarktfonds, die zu steuerlichen Zwecken gehalten werden, oder (iii) Derivate zu Absicherungszwecken, (iv) Unternehmen mit einem „ESG Materiality Rating“ von 4 oder 5, oder (v) Unternehmen, die nicht dem „ESG Materiality Model“ unterliegen.

Diese Investitionen werden nicht zum Erfüllen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios genutzt. Der Zweck dieser Wertpapiere besteht darin, ein diversifiziertes Portfolio zu erreichen, das die finanzielle Zielstellung erreichen kann.

Mindestschutz zu Umwelt oder Sozialem wird durch Ausschluss-Screening aller Beteiligungen an Unternehmen, in die investiert wird, gewährleistet. Bei Barpositionen und Derivaten sind ESG-Erwägungen in die Bewertung des Kontrahentenrisikos integriert.

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



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

Wir führten Gespräche mit Unternehmen, mit dem Ziel, ihre Herangehensweise in Bezug auf ESG-Risiken und ESG-Praktiken zu beeinflussen.

Im Berichtszeitraum haben wir uns beispielsweise mit ASM International in Verbindung gesetzt und Themen zu Unternehmensführung und Einbeziehung von ESG-Metriken in die Vergütung von Führungskräften besprochen. Dadurch wird die Übernahme von Verantwortung durch Führungskräfte gefördert. Nach unserem Engagement stimmte das Unternehmen der Umsetzung zu. Darüber hinaus hat das Unternehmen nach Engagements im Jahr 2022 die Diversität am Arbeitsplatz gesteigert und zukünftige Ziele bei der geschlechterverteilten Neueinstellung festgelegt. Schließlich hat das Unternehmen das Emissionsziel in Übereinstimmung mit dem globalen „1.5C-Pathway“ festgelegt.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?

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

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie unterscheidet sich die Referenzbenchmark von einem breiten Marktindex?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **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?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Referenzbenchmark abgeschnitten?**

Nicht zutreffend – das Finanzprodukt hat keine festgelegte Referenzbenchmark, anhand derer gemessen wird, ob es die Umwelt- und/oder sozialen Eigenschaften erfüllt, die das Portfolio fördert.

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

Während des Berichtszeitraums wies das Finanzprodukt ein hervorragendes ESG-Profil gegenüber dem „Euromoney Small Europe ex-UK Index“ auf, gemessen am Modell „Columbia Threadneedle Investments ESG Materiality Rating“.

Angaben zur EU-Taxonomieverordnung (ungeprüft)

Die Verordnung (EU) 2020/852 ist ein Rahmen zur Erleichterung nachhaltiger Investitionen (die „EU-Taxonomie-Verordnung“), in der Kriterien festgelegt sind, anhand derer bestimmt werden kann, ob eine Wirtschaftstätigkeit in Bezug auf sechs Umweltziele als ökologisch nachhaltig einzustufen ist („Taxonomiekonform“). Die EU-Taxonomieverordnung verlangt, dass bestimmte Angaben in diesem Bericht gemacht werden.

Artikel 6 Finanzprodukte

Die den nachstehend aufgeführten Finanzprodukten zugrunde liegenden Anlagen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomieverordnung. Zu den Artikel 6 Finanzprodukten gehören:

- Threadneedle (Lux) – American
- Threadneedle (Lux) – American Absolute Alpha
- Threadneedle (Lux) – American Extended Alpha
- Threadneedle (Lux) – American Select
- Threadneedle (Lux) – Asia Contrarian Equity
- Threadneedle (Lux) – Asian Equity Income
- Threadneedle (Lux) – Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) – Emerging Market Corporate Bonds
- Threadneedle (Lux) – Emerging Market Debt
- Threadneedle (Lux) – Enhanced Commodities
- Threadneedle (Lux) – Euro Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) – European Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) – European Short-Term High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) – European Strategic Bond
- Threadneedle (Lux) – Flexible Asian Bond
- Threadneedle (Lux) – Global Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) – Global Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) – Global Emerging Market Equities
- Threadneedle (Lux) – Global Emerging Market Short-Term Bonds
- Threadneedle (Lux) – Global Extended Alpha
- Threadneedle (Lux) – Global Investment Grade Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) – Global Multi Asset Income
- Threadneedle (Lux) – Global Technology
- Threadneedle (Lux) – Pan European Absolute Alpha
- Threadneedle (Lux) – Pan European Equity Dividend
- Threadneedle (Lux) – Pan European Small Cap Opportunities
- Threadneedle (Lux) – UK Equities
- Threadneedle (Lux) – UK Equity Income
- Threadneedle (Lux) – US Contrarian Core Equities
- Threadneedle (Lux) – US Disciplined Core Equities
- Threadneedle (Lux) – US High Yield Bond

Artikel 8 Finanzprodukte, mit denen ökologische Merkmale beworben werden

Die Anlagen, die den nachfolgend aufgeführten Artikel 8-Finanzprodukten zugrunde liegen, die ökologische Merkmale bewerben, unterliegen nicht der Verpflichtung, die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomieverordnung zu berücksichtigen, sodass der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ der EU-Taxonomieverordnung für sie nicht gilt. Basierend auf zuverlässigen Daten, die zum Zeitpunkt dieses Berichts zur Verfügung stehen, sind 0 % der Investitionen in die Finanzprodukte taxonomiekonform.

- Threadneedle (Lux) – American Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Asia Equities
- Threadneedle (Lux) – European Select
- Threadneedle (Lux) – European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Global Equity Income
- Threadneedle (Lux) – Global Focus
- Threadneedle (Lux) – Global Select
- Threadneedle (Lux) – Global Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Pan European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – European High Yield Bond

Angaben zur EU-Taxonomieverordnung (ungeprüft)

(Fortsetzung)

- Threadneedle (Lux) – Pan European ESG Equities
- Threadneedle (Lux) – Emerging Market ESG Equities

Artikel 8 Finanzprodukte, mit denen keine ökologischen Merkmale beworben werden

Threadneedle (Lux) – European Social Bond bewirbt nur soziale Merkmale. Daher berücksichtigen die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Anlagen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten im Rahmen der EU-Taxonomie-Verordnung, und 0 % der Investitionen des Finanzprodukts unterliegen der Verpflichtung, taxonomiekonform zu sein.

Adressverzeichnis

Eingetragener Firmensitz

31, Z.A. Bourmicht
L-8070 Bertrange
Großherzogtum Luxemburg

Anlageberater

Threadneedle Management Luxembourg S.A.

Verwaltungsgesellschaft

Threadneedle Management Luxembourg S.A.
44, rue de la Vallée
L-2661 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Unterbevollmächtigte¹:

Columbia Management
Investment Advisers, LLC
225 Franklin Street
Boston, MA 02110
Vereinigte Staaten von Amerika

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities²
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities²
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities
Threadneedle (Lux) - Global Technology

Threadneedle Asset
Management Limited
Cannon Place
78 Cannon Street
London EC4N 6AG
Vereinigtes Königreich

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond³
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond
Threadneedle (Lux) - European Social Bond
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds³
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt³
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds³
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond⁴
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income⁵
Threadneedle (Lux) - Global Focus
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income
Threadneedle (Lux) - Global Select
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - American⁵
Threadneedle (Lux) - American Select⁵
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies⁵
Threadneedle (Lux) - Asia Equities⁴
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities⁵
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - European Select
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income⁴
Threadneedle (Lux) - UK Equities
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha⁵
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities³

Adressverzeichnis

(Fortsetzung)

Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited 3 Killiney Road #07-07 Winsland House 1 Singapore 239519 Singapur	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity ⁶
STANLIB Asset Management (Pty) Limited 17 Melrose Boulevard Melrose Arch 2196 Johannesburg Südafrika	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity ⁷

¹Unter der Verantwortlichkeit und Aufsicht von Threadneedle Management Luxembourg S.A.

²Threadneedle Asset Management Limited gibt Columbia Management Investment Advisers, LLC Anlageempfehlungen und erteilt der Columbia Management Investment Advisers, LLC daher eine auf Research gestützte Anlageberatung.

³Threadneedle Asset Management Limited kann vorbehaltlich ihrer eigenen Haftung die diskretionäre Anlageverwaltung eines Teils des Portfoliovermögens an Columbia Management Investment Advisers, LLC (mit Wirkung vom 1. August 2022 für Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities) delegieren.

⁴Threadneedle Asset Management Limited kann vorbehaltlich ihrer eigenen Haftung die diskretionäre Anlageverwaltung eines Teils des Portfoliovermögens an Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited delegieren.

⁵Columbia Management Investment Advisers, LLC gibt Threadneedle Asset Management Limited Anlageempfehlungen und erteilt der Threadneedle Asset Management Limited daher eine auf Research gestützte Anlageberatung.

⁶Columbia Management Investment Advisers, LLC gibt Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited Anlageempfehlungen und stellt daher für Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited eine auf Analysen gestützte Anlageberatung bereit.

⁷Siehe Erläuterung 1.

Adressverzeichnis

(Fortsetzung)

Verwahr-, Domicil-, Verwaltungs- und Zahlstelle

Citibank Europe plc, Zweigniederlassung Luxemburg
31, Z.A. Bourmicht
L-8070 Bertrange
Großherzogtum Luxemburg

Register- und Transferstelle

International Financial Data Services (Luxembourg) S.A.
49, avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Vertriebsstelle (an verschiedene Vertriebsgesellschaften delegiert)

Threadneedle Management Luxembourg S.A.
44, rue de la Vallée
L-2661 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Vertreter und Zahlstellen

In Österreich

Erste Bank
Am Belvedere 1
1100 Wien
Österreich

In Belgien

CACEIS Belgium S.A
Avenue du Port 86 C b 320
B-1000 Brüssel
Belgien

In Frankreich

CACEIS Bank
1/3 Place Valhubert
75013 Paris
Frankreich

In Deutschland

J.P. Morgan AG
Junghofstraße 14
D-60311 Frankfurt am Main
Deutschland

In Hongkong

HSBC Institutional Trust Services (Asia) Limited
17/F Tower 2 & 3 HSBC Centre
1 Sham Mong Road
Kowloon
Hongkong

In der Schweiz

RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette
Succursale de Zurich
Bleicherweg 7
CH-8027 Zürich
Schweiz

Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers, *Société coopérative*
2, rue Gerhard Mercator, B.P. 1443
L-1014 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Rechtsberater in Luxemburg

Linklaters LLP
35, Avenue John F. Kennedy, B.P. 1107
L-1011 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Weitere Informationen finden Sie auf unserer Website: columbiathreadneedle.com



Herausgegeben von Threadneedle Management Luxembourg S.A. Beim luxemburgischen Registre de Commerce et des Sociétés (Handels- und Gesellschaftsregister) unter der Nummer B 110242 eingetragen, 44, rue de la Vallée, L-2661 Luxembourg, Großherzogtum Luxemburg. Im Vereinigten Königreich herausgegeben von Threadneedle Asset Management Limited (TAML) Eingetragen in England und Wales unter der Registernummer 573204, Cannon Place, 78 Cannon Street, London EC4N 6AG, Vereinigtes Königreich. Im Vereinigten Königreich zugelassen und reguliert von der Financial Conduct Authority. Columbia Threadneedle Investments ist der globale Markenname der Columbia- und Threadneedle-Unternehmensgruppe. columbiathreadneedle.com

467660