

CS Investment Funds 4

Investmentgesellschaft mit variablem Kapital luxemburgischen
Rechts - R.C.S. Luxembourg B 134 528

Ungeprüfter Halbjahresbericht

zum 31.05.2016

Verwaltung und Organe	3
Konsolidierter Bericht	5
Erläuterungen	7
Bericht per Subfonds	
Credit Suisse (Lux) CS AllHedge Index Fund	11
Credit Suisse (Lux) Fund of Liquid Alternative Beta Funds	12
Credit Suisse (Lux) FundSelection Balanced EUR	20
Credit Suisse (Lux) FundSelection Yield EUR	25
Credit Suisse (Lux) Global Emerging Market Brands Equity Fund	30
Credit Suisse (Lux) Global High Income Fund USD	35
Credit Suisse (Lux) Multi-Advisor Equity Alpha Fund	49
Credit Suisse (Lux) Multimanager Emerging Markets Equity Fund	69
Credit Suisse (Lux) Multimanager Enhanced Fixed Income USD Fund	73
Credit Suisse (Lux) Multimanager Japan Equity Fund	77
Credit Suisse (Lux) Prima Growth Fund	78
Credit Suisse (Lux) Prima Multi-Strategy Fund	83
Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund	89
Credit Suisse (Lux) SystematicReturn Fund USD	97

Gesellschaft

CS Investment Funds 4
5, rue Jean Monnet, L-2180 Luxembourg
R.C.S. Luxembourg B 134 528

Verwaltungsrat der Gesellschaft

Dominique Delèze, Mitglied des Verwaltungsrates
Director, Credit Suisse AG, Zürich

Josef H.M. Hehenkamp, Mitglied des Verwaltungsrates
Director, Credit Suisse AG, Zürich

Rudolf Kömen, Mitglied des Verwaltungsrates
Director, Credit Suisse Fund Management S.A., Luxemburg

Guy Reiter, Mitglied des Verwaltungsrates
Director, Credit Suisse Fund Management S.A., Luxemburg

Fernand Schaus, Mitglied des Verwaltungsrates
Director, Credit Suisse Fund Management S.A., Luxemburg

Abschlussprüfer der Gesellschaft

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
2, rue Gerhard Mercator, L-2182 Luxembourg

Verwaltungsgesellschaft

Credit Suisse Fund Management S.A.
5, rue Jean Monnet, L-2180 Luxembourg
R.C.S. Luxembourg B 72 925

Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

Luca Diener, Mitglied des Verwaltungsrates
Managing Director, Credit Suisse AG, Zürich

Thomas Nummer, Mitglied des Verwaltungsrates
Unabhängig Director, Luxemburg

Rudolf Kömen, Mitglied des Verwaltungsrates
Director, Credit Suisse Fund Management S.A., Luxemburg

Guy Reiter, Mitglied des Verwaltungsrates
Director, Credit Suisse Fund Management S.A., Luxemburg

Daniel Siepmann, Mitglied des Verwaltungsrates
Director, Credit Suisse Fund Services (Luxembourg) S.A., Luxemburg

Abschlussprüfer der Verwaltungsgesellschaft

KPMG Luxembourg, Société coopérative
39, avenue John F. Kennedy, L-1855 Luxembourg

Vertreter in der Schweiz

Credit Suisse Funds AG
Uetlibergstrasse 231, Postfach, CH-8070 Zürich

Zahlstelle in der Schweiz

Credit Suisse AG
Paradeplatz 8, CH-8001 Zürich

Informationsstelle in Deutschland

Credit Suisse (Deutschland) AG
Junghofstrasse 16, D-60311 Frankfurt/Main

Zahlstelle in Österreich

UniCredit Bank Austria AG
Schottengasse 6-8, A-1010 Vienna

Zentralkorrespondenzstelle in Frankreich

BNP PARIBAS Securities Services
3, rue d'Antin, F-75002 Paris Cedex 08

Zahlstelle und Vertreter im Fürstentum Liechtenstein

LGT Bank in Liechtenstein Aktiengesellschaft
Herrengasse 12, FL-9490 Vaduz

Depotbank

Credit Suisse (Luxembourg) S.A.
5, rue Jean Monnet, L-2180 Luxembourg

Vertriebsstelle

Credit Suisse Fund Services (Luxembourg) S.A. (bis zum 01.04.2016)
5, rue Jean Monnet, L-2180 Luxembourg

Credit Suisse Fund Management S.A. (seit dem 01.04.2016)
5, rue Jean Monnet, L-2180 Luxembourg

Vertriebsstelle in der Schweiz

Credit Suisse Funds AG
Uetlibergstrasse 231, Postfach, CH-8070 Zürich

Fazilitätsstelle für das Vereinigte Königreich

Credit Suisse Asset Management Limited
One Cabot Square, London E14 4QJ, United Kingdom

Anlageverwalter

Credit Suisse Asset Management LLC, New York
One Madison Avenue, NY-10010 New York

- Credit Suisse (Lux) Fund of Liquid Alternative Beta Funds
- Credit Suisse (Lux) Multi-Advisor Equity Alpha Fund

Credit Suisse AG
Paradeplatz 8, CH-8001 Zürich

- Credit Suisse (Lux) FundSelection Balanced EUR
- Credit Suisse (Lux) FundSelection Growth EUR
- Credit Suisse (Lux) FundSelection Yield EUR
- Credit Suisse (Lux) Multimanager Emerging Markets Equity Fund
- Credit Suisse (Lux) Multimanager Enhanced Fixed Income USD Fund
- Credit Suisse (Lux) Global Equity Theme Fund
- Credit Suisse (Lux) Global High Income Fund USD
- Credit Suisse (Lux) Prima Growth Fund
- Credit Suisse (Lux) Prima Multi-Strategy Fund
- Credit Suisse (Lux) SystematicReturn Fund USD

Credit Suisse Asset Management Limited, London
One Cabot Square, London E14 4QJ, United Kingdom als Anlageverwalter und
Credit Suisse Asset Management LLC, New York als Unter-Anlageverwalter

- Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund

Am 01.01.2016, wurde Credit Suisse Asset Management LLC, New York, als Anlageverwalter mit der Verwaltung dieses Subfonds beauftragt.

Credit Suisse AG, Parade Platz 8, CH-8001 Zürich und Credit Suisse (Singapore) Limited

- Credit Suisse (Lux) Global Emerging Market Brands Equity Fund

Zentrale Verwaltungsstelle

Credit Suisse Fund Services (Luxembourg) S.A.
5, rue Jean Monnet, L-2180 Luxembourg

Keine Zeichnung darf auf der Grundlage der Geschäftsberichte entgegen-
genommen werden. Die Zeichnungen erfolgen nur auf der Grundlage des
aktuellen Verkaufsprospektes, dem die wesentlichen Anlegerinformationen sowie
der letzte Jahresbericht und gegebenenfalls der letzte Halbjahresbericht falls
dieser aktueller ist, beigelegt sind.

Die Ausgabe- und Rücknahmepreise werden in Luxemburg am Sitz der Ver-
waltungsgesellschaft veröffentlicht.
Der Nettoinventarwert wird ebenfalls täglich im Internet veröffentlicht unter
www.credit-suisse.com sowie in verschiedenen Zeitungen.

Der Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die letzten Jahres-
und Halbjahresberichte (nebst der Aufstellung aller während der Berichtsperiode
eingetretenen Veränderungen in der Zusammensetzung des
Wertpapierbestandes) und Kopien der Satzung sind für die Anleger am Sitz der
Verwaltungsgesellschaft, der lokalen Vertreter in den Ländern, in welchen die
Gesellschaft registriert ist, oder bei der deutschen Zahl- und Informationsstelle
sowie der weiteren Informationsstelle in Deutschland kostenlos in Papierform
erhältlich.

Nettovermögensaufstellung in USD

	31.05.2016
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	4.271.617.606,84
Bankguthaben und sonstige	120.242.427,96
Forderungen aus Zeichnungen	4.189.194,11
Forderungen aus Erträgen	1.520.391,04
Im Voraus bezahlte Kosten	1.756,45
Gründungskosten	24.117,44
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Finanzterminkontrakten	82.066,26
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften	532.902,56
Andere Aktiva	<u>12.030,62</u>
	4.398.222.493,28
Passiva	
Bankverbindlichkeiten und sonstige	662.428,84
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	14.081.393,66
Rückstellungen für Aufwendungen	4.197.229,72
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Finanzterminkontrakten	6.060,25
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Swapkontrakten	2.685.514,80
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	12.359.926,82
Andere Passiva	<u>2.659,43</u>
	33.995.213,52
Nettovermögen	4.364.227.279,76

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens in USD

Für die Periode vom
01.12.2015 bis zum
31.05.2016

Nettovermögen zu Beginn der Periode	4.665.643.595,44
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	1.401.399,62
Dividenden (Netto)	3.843.805,76
Bankzinsen	32.683,68
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	42.647,97
Andere Erträge	1.357.945,57
	6.678.482,60
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	19.135.137,34
Unter-Anlageverwaltergebühr	468.457,23
Depotbank- und Depotgebühr	946.491,83
Verwaltungskosten	1.891.554,40
Druck- und Veröffentlichungskosten	287.945,87
Zinsen und Bankspesen	77.789,81
Kosten für Revision, Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	1.070.877,07
"Taxe d'abonnement"	158.256,41
Abschreibung der Gründungskosten	10.378,19
	24.046.888,15
Nettoerträge (-verluste)	-17.368.405,55
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	4.466.493,18
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	585.320,12
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	-12.073.903,45
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-64.841.598,32
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	12.157.861,41
	-59.705.827,06
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-77.074.232,61
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-50.689.371,64
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Finanzterminkontrakten	163.245,06
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-4.474.698,05
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	73.104.303,11
	18.103.478,48
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	-58.970.754,13
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	635.012.619,27
Rücknahmen	-1.016.463.063,86
	-381.450.444,59
Ausschüttung	-2.197.678,38
Währungsdifferenz	141.202.561,42
Nettovermögen am Ende der Periode	4.364.227.279,76

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Allgemeines

CS Investment Funds 4 (die «Gesellschaft») wurde am 30.11.2007 als offener Anlagefonds in Form einer Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (société d'investissement à capital variable, SICAV) gemäss Teil I des luxemburgischen Gesetzes vom 17.12.2010 in seiner gültigen Fassung über Organismen für gemeinsame Anlagen gegründet.

Zum 31.05.2016 hatte die Gesellschaft 12 Subfonds.

Veränderungen:

Während des Geschäftsperiode hat der Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund aufgrund einer ineffizienten Umsetzung von Währungsabsicherungsgeschäften im Fixed-Income-Portfolio eine Underperformance verzeichnet. Diese Situation wurde inzwischen wieder korrigiert. Die Credit Suisse hat die Angelegenheit ausführlich geprüft und den Subfonds entsprechend entschädigt. Diese Entschädigung wurde im Nettovermögenswert des Subfonds vom 15.01.2016 bereits berücksichtigt.

Aktionäre, die ihre Aktien zurückgegeben haben und zum Zeitpunkt der Rücknahme eine Underperformance erlitten, haben eine Ausgleichszahlung über den Wert dieser Underperformance in bar erhalten. Anleger, die ihre Aktien zurückgegeben, aber diesbezüglich keine Barentschädigung erhalten haben, werden darauf hingewiesen, dass die CS basierend auf den Luxemburger Vorschriften für die Anlegerentschädigung entschieden hat, dass der erlittene Verlust geringfügig war und der Subfonds daher nicht verpflichtet ist, Entschädigungszahlungen zu leisten.

In der nachstehenden Tabelle ist der NIW pro Aktie einschließlich des Entschädigungsbetrags aufgeführt:

Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund -B- USD	113,84
Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund -IB- USD	115,53
Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund -UB- USD	91,28
Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund -BH- CHF	91,07
Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund -IBH- CHF	91,92
Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund -BH- EUR	115,40
Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund -IBH- EUR	117,15
Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund -UBH- EUR	96,68
Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund -BHX- GBP	103,72
Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund -UBH- GBP	96,37
Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund -BH- SEK	954,81

Die Gesellschaft hat entschieden, den Credit Suisse (Lux) Multimanager Japan Equity Fund zum 09.12.2015 zu liquidieren. Der letzte NIW wurde am 10.12.2015 berechnet.

Am 22.12.2015 hat der Verwaltungsrat des Credit Suisse (Lux) CS AllHedge Index Fund beschlossen, den Subfonds im besten Interesse der Aktionäre zu schließen. Grund hierfür ist, dass angesichts anhaltender und regelmäßiger Rücknahmen eine angemessene Verwaltung des Subfonds im besten Interesse der Aktionäre nicht mehr gewährleistet werden kann.

Am 29.01.2016 wurde der Credit Suisse (Lux) Multi-Advisor Equity Alpha Fund aufgelegt, der erste NIW wurde am 01.02.2016 berechnet.

Credit Suisse (Lux) CS AllHedge Index Fund -IBH- EUR: der letzte NIW wurde am 31.03.2016 berechnet.

Wesentliche Bilanzierungs- und Bewertungsgrundsätze

a) Darstellung der Abschlüsse

Die Darstellung der Abschlüsse erfolgt gemäss den Anforderungen der luxemburger Aufsichtsbehörden.

b) Berechnung des Nettoinventarwertes des jeweiligen Subfonds

Credit Suisse (Lux) CS AllHedge Index Fund:

Als Bewertungstag gilt jeder Donnerstag, der in London und in Luxemburg ein Bankgeschäftstag ist. Fällt dieser Tag in London bzw. Luxemburg auf einen Feiertag, findet die Bewertung am nächstfolgenden Bankgeschäftstag statt.

Wenn die Märkte in London bzw. New York an einem der zwischen den Handelstagen (einschliesslich) und den Bewertungstagen (nicht inbegriffen) fallenden Bankgeschäftstagen geschlossen sind, wird die Berechnung des Nettovermögenswertes je Aktie ohne ungebührliche Verzögerungen verschoben,

bis die für die Bewertung notwendigen Angaben auf normalem Weg erhältlich sind.

Wenn die gesamten Transaktionen in Aktien eines bestimmten Subfonds an einem Bewertungstag zu einem Nettozuwachs- bzw. -rückgang von Aktien führen, welcher über dem jeweils durch den Verwaltungsrat für den betreffenden Subfonds definierten bzw. angepassten Grenzwert hinausgeht, wird der Nettovermögenswert des betreffenden Subfonds bei einem Nettozuwachs um 0,50% und bei einem Nettorückgang um 1,50% angepasst. Diese Anpassung umfasst einerseits die eventuell durch den Subfonds getragenen Transaktionskosten und andererseits die geschätzte Spread-Marge zwischen dem Kauf- und dem Verkaufskurs von (i) den Vermögenswerten, in welchen der betreffende Subfonds anlegt, und (ii) den Bestandteilen des massgeblichen als Basiswert dienenden Index.

Falls die aggregierten Nettorücknahmeanträge (einschliesslich der aggregierten Nettozeichnungsanträge) in einem bestimmten kalendarischen Quartal 10% des zu Beginn des betreffenden Quartals festgestellten Nettovermögenswertes übersteigen, wird der Nettovermögenswert des betreffenden Subfonds zum massgeblichen Bewertungstag um 3% (anstatt um 1,5% wie oben unter „Angaben zu den Subfonds und ihren Aktien“ dargestellt) gekürzt.

Falls die aggregierten Nettorücknahmeanträge (einschliesslich der Nettozeichnungsanträge) in einem bestimmten kalendarischen Quartal 20% des zu Beginn des betreffenden Quartals festgestellten Nettovermögenswertes übersteigen, kann der Nettovermögenswert des betreffenden Subfonds auf Basis von angemessenen, Marktteilnehmer gestellten Kaufpreisen (anstelle des oben beschriebenen festen Prozentanteils) ermittelt werden.

Am 31.03.2016 wurde der letzte NIW berechnet.

Credit Suisse (Lux) Fund of Liquid Alternative Beta Funds:

Der Nettovermögenswert der Aktien des Subfonds wird an jedem Tag berechnet, an dem die Banken in Luxemburg und New York ganztägig geöffnet sind (diese Tage werden jeweils als «Bewertungstag» bezeichnet).

Der Bericht reflektiert die am 31.05.2016 berechneten Nettoinventarwerte.

Credit Suisse (Lux) Global Emerging Market Brands Equity Fund:

Der Nettovermögenswert je Aktie des Subfonds wird an jedem Bankgeschäftstag berechnet.

Der Bericht reflektiert die am 31.05.2016 berechneten Nettoinventarwerte.

Bei Nettozeichnungsanträgen bzw. -rücknahmeanträgen wird der in ermittelte Nettovermögenswert für die an diesem Bewertungstag erhaltenen Zeichnungs- bzw. Rücknahmeanträge je Aktie um bis zu 2% des Nettovermögenswertes erhöht bzw. verringert. Der Nettovermögenswert wird an jedem Bewertungstag auf Grundlage des Nettohandels angepasst, ungeachtet des Umfangs des Nettokapitalflusses (d. h. für eine Anpassung des Nettovermögenswertes ist nicht das Erreichen eines vordefinierten Schwellenwertes für den Nettokapitalfluss erforderlich).

Credit Suisse (Lux) Multimanager Emerging Markets Equity Fund, Credit Suisse (Lux) Multimanager Enhanced Fixed Income USD Fund, Credit Suisse (Lux) Multimanager Japan Equity Fund, Credit Suisse (Lux) FundSelection Balanced EUR, Credit Suisse (Lux) FundSelection Yield EUR, Credit Suisse (Lux) Global High Income Fund USD, Credit Suisse (Lux) Multi-Advisor Equity Alpha Fund, Credit Suisse (Lux) SystematicReturn Fund USD und Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund:

Der Nettovermögenswert je Aktie des Subfonds wird an jedem Bankgeschäftstag berechnet.

Der Bericht reflektiert die am 31.05.2016 berechneten Nettoinventarwerte.

Der Nettovermögenswert für die an diesem Bewertungstag eingegangenen Zeichnung bzw. Rücknahmeanträge bei einem Nettoüberschuss an Zeichnungsanträgen um bis zu 2% des Nettovermögenswertes je Aktie erhöht bzw. bei einem Nettoüberschuss an Rücknahmeanträgen um bis zu 2% verringert.

In Ausnahmefällen kann die Verwaltungsgesellschaft im Interesse der Aktionäre beschließen, den vorstehend angegebenen maximalen Swing-Faktor zu erhöhen.

Credit Suisse (Lux) Prima Growth Fund und Credit Suisse (Lux) Prima Multi-Strategy Fund:

Der Nettovermögenswert je Aktie des Subfonds wird wöchentlich jeweils am Donnerstag berechnet. Fällt dieser Tag nicht auf einen Bankgeschäftstag in Luxemburg und London, erfolgt die Berechnung am unmittelbar folgenden Bankgeschäftstag («Bewertungstag») an diesen Standorten.

Der Bericht reflektiert die am 31.05.2016 berechneten Nettoinventarwerte.

c) Bewertung des Wertpapierbestandes des jeweiligen Subfonds

Wertpapiere, die an einer Börse notiert sind oder regelmässig an einer solchen Börse gehandelt werden, sind nach dem letzten verfügbaren bezahlten Kurs zu bewerten. Fehlt für einen Handelstag ein solcher, ist aber ein Schlussmittelkurs (Mittelwert zwischen einem Schlussgeld- und Schlussbriefkurs) oder ein Schlussgeldkurs notiert, kann auf den Schlussmittelkurs oder alternativ auf den Schlussgeldkurs abgestellt werden.

Wenn ein Wertpapier an verschiedenen Börsen gehandelt wird, erfolgt die Bewertung in Bezug auf die Börse, an der das Wertpapier hauptsächlich gehandelt wird.

Bei Wertpapieren, für welche der Börsenhandel unbedeutend ist, für welche jedoch ein Zweitmarkt mit geregelter Freiverkehr zwischen Anlagehändlern besteht, der zu einer marktmässigen Preisbildung führt, kann die Bewertung aufgrund des Zweitmarktes vorgenommen werden.

Wertpapiere, die an einem geregelten Markt gehandelt werden, werden nach der gleichen Methode bewertet wie diejenigen, die an einer Börse notiert werden.

Wertpapiere, die nicht an einer Börse notiert werden und nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden, werden zum letzten vorliegenden Marktpreis bewertet. Ist ein solcher nicht verfügbar, erfolgt die Bewertung der Wertpapiere durch die Gesellschaft gemäss anderen durch den Verwaltungsrat festzulegenden Kriterien und auf der Grundlage des voraussichtlich möglichen Verkaufspreises, dessen Wert mit der gebührenden Sorgfalt und nach bestem Wissen veranschlagt wird.

Anteile bzw. Aktien an OGA werden nach ihrem letzten errechneten Nettovermögenswert bewertet, gegebenenfalls unter Berücksichtigung der Rücknahmegebühr. Falls für Anteile an OGA kein Nettovermögenswert zur Verfügung steht, sondern lediglich An- und Verkaufspreise, so können die Anteile bzw. Aktien solcher OGA zum Mittelwert zwischen solchen An- und Verkaufspreisen bewertet werden.

Der Bewertungspreis eines Geldmarktinstruments wird, ausgehend vom Nettoerwerbskurs und unter Beibehaltung der resultierenden Anlagerendite, sukzessive dem Rücknahmepreis angepasst. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen muss die Grundlage für die Bewertung verschiedener Anlagen an den neuen Markttrenditen ausgerichtet werden.

Wird aufgrund besonderer oder veränderter Umstände eine Bewertung unter Beachtung der vorstehenden Regeln undurchführbar oder unrichtig, dann ist der Verwaltungsrat der Gesellschaft berechtigt, andere allgemein anerkannte und von Wirtschaftsprüfern nachprüfbar Bewertungsregeln zu befolgen, um eine sachgerechte Bewertung des Vermögens des Sub-fonds zu erreichen.

d) Bankguthaben bei Banken und Brokern

Bankguthaben bei Banken und Brokern umfassen Kassenbestände, Margin Calls und kurzfristige Einlagen bei Banken sowie andere kurzfristige Anlagen in einem aktiven Markt mit ursprünglichen Laufzeiten von höchstens drei Monaten und Kontokorrentkrediten.

e) Realisierter Nettogewinn/-verlust aus Wertpapieren des jeweiligen Subfonds

Die aus den Verkäufen von Wertpapieren resultierenden realisierten Gewinne oder Verluste werden auf der Basis des durchschnittlichen Einstandspreises berechnet.

f) Umrechnung der ausländischen Währungen

Der Bericht erfolgt in der Referenzwährung des jeweiligen Subfonds und der konsolidierte Bericht wird in USD erstellt.

Die Bankguthaben, die anderen Nettovermögenswerte sowie die Bewertung der Wertpapiere, die auf andere Währungen als die Referenzwährung des jeweiligen Subfonds lauten, werden zum Wechselkurs des Bewertungstages in die Referenzwährung umgerechnet.

Die Erträge und Kosten in Fremdwährungen, werden zum Wechselkurs des Abrechnungstages in die Referenzwährung umgerechnet.

Die Währungsgewinne oder -verluste sind im Bericht in der „Ertrags- und Aufwandsrechnung“ berücksichtigt.

Der Einstandswert der Wertpapiere in anderen Währungen als der Referenzwährung des jeweiligen Subfonds, wird zu dem am Tag des Erwerbs gültigen Wechselkurs in die Referenzwährung umgerechnet.

g) Buchung der Geschäfte im Wertpapierbestand des jeweiligen Subfonds
Die Wertpapiergeschäfte werden an den Transaktionstagen gebucht.

h) Gründungskosten des jeweiligen Subfonds

Die Gründungskosten werden über eine Periode von 5 Jahren abgeschrieben.

i) Bewertung der Devisentermingeschäfte des jeweiligen Subfonds

Die noch nicht fälligen Devisentermingeschäfte werden mit den am Bewertungstag gültigen Terminwechselkursen bewertet, und die daraus resultierenden Änderungen in nichtrealisierten Gewinne oder Verluste werden in der „Ertrags- und Aufwandsrechnung“ verbucht und unter „Nichtrealisierter Nettomehrwert/-verlust aus Devisentermingeschäften“ in der Nettovermögensaufstellung ausgewiesen.

j) Bewertung der Finanzterminkontrakte des jeweiligen Subfonds

Die noch nicht fälligen Finanzterminkontrakte werden mit den am Bewertungstag gültigen Marktpreisen bewertet, und die daraus resultierenden Veränderung der nichtrealisierten Gewinne oder Verluste werden in der „Ertrags- und Aufwandsrechnung“ verbucht und unter „Nichtrealisierter Nettomehrwert/-verlust aus Finanzterminkontrakten“ in der Nettovermögensaufstellung ausgewiesen.

k) Bewertung der Swaps des jeweiligen Subfonds

Die Bewertung von Swap-Vereinbarungen erfolgt an jedem Bewertungstag zum aktuellen Barwert der künftigen Cashflows, wobei zu deren Berechnung die jeweilige Zinsstrukturkurve am Bewertungstag herangezogen wird.

Bei Excess Return Swaps wird der zugrundeliegende Basiswert zur Bewertung herangezogen.

Die resultierenden Veränderung der nichtrealisierten Gewinne oder Verluste werden unter „Nichtrealisierter Nettomehrwert/Wertminderung aus Swapkontrakten“ in der Nettovermögensaufstellung ausgewiesen.

l) Zuordnung der Aufwendungen

Jedem Subfonds werden die Aufwendungen belastet, die ihm direkt zugerechnet werden können. Nicht direkt zurechenbare Aufwendungen werden nach Massgabe der Angemessenheit aufgeteilt.

m) Ertragsermittlung

Dividenden werden abzüglich Quellensteuer an ihrem Ex-Tag verbucht. Zinserträge werden auf täglicher Basis abgegrenzt.

n) Andere Erträge

Die während des Jahres erhaltenen Trailer Kommissionen werden unter Andere Erträge gebucht.

Verwaltungsgebühr und Zusatzentschädigung

(siehe Detail auf Subfondsebene)

Als Vergütung ihrer Tätigkeit und zur Rückzahlung ihrer Kosten hat die Verwaltungsgesellschaft Anspruch auf eine jährliche Verwaltungsgebühr, zahlbar am Ende eines jeden Monats und errechnet auf der Grundlage des durchschnittlichen täglichen Nettoinventarwertes während des entsprechenden Monats.

Für den Credit Suisse (Lux) Prima Multi-Strategy, Credit Suisse (Lux) Prima Growth, Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund und Credit Suisse (Lux) SystematicReturn Fund USD, steht der Verwaltungsgesellschaft für diese Subfonds neben der Verwaltungsgebühr eine erfolgsbezogene Zusatzentschädigung («Performance Fee») zu, welche auf Basis des Nettovermögenswertes der jeweiligen Anteilklasse errechnet wird. Die Berechnung erfolgt jeweils zeitgleich mit der Berechnung des Nettovermögenswertes selbst (Siehe Näheres dazu im Prospekt).

Für Credit Suisse (Lux) Fund of Liquid Alternative Beta Funds, Credit Suisse (Lux) FundSelection Balanced EUR, Credit Suisse (Lux) FundSelection Yield EUR, Credit Suisse (Lux) Global Emerging Market Brands Equity Fund, Credit Suisse (Lux) Prima Multi-Strategy Fund und Credit Suisse (Lux) Prima Growth Fund: Neben den Kosten der Gesellschaft für die Verwaltung der Subfonds wird dem Vermögen des Subfonds indirekt eine Verwaltungsvergütung für die in ihm enthaltenen Zielfonds von eben diesen Zielfonds belastet.

Unter-Anlageverwaltergebühr

Credit Suisse (Lux) Multi-Advisor Equity Alpha Fund zahlt diese Gebühr direkt an den Unter-Anlageberater, um alle durch den Unter-Anlageverwalter erbrachten Anlageempfehlungen sowie Equity-Research-Dienstleistungen abzudecken.

"Taxe d'abonnement"

Entsprechend der Gesetzgebung und den gegenwärtig in Kraft befindlichen Verordnungen unterliegt die Gesellschaft in Luxemburg, aufgrund ihrer Anlagen, der „Taxe d'abonnement“ zum Jahressatz von 0,05%, zahlbar pro Quartal und berechnet auf der Grundlage des Nettovermögens des jeweiligen Subfonds am Ende eines jeden Quartals. Bei Aktienklassen, die institutionellen Anlegern vorbehalten sind, beträgt diese Steuer 0,01% p. a.

Diese Steuer fällt nicht für den Teil des Fondsvermögens an, der in andere Organismen für gemeinsame Anlagen für gemeinsame Anlagen Luxemburger Rechts angelegt ist.

Total Expense Ratio (TER)

(siehe Detail auf Subfondsebene)

Die TER (Total Expense Ratio) bezeichnet die Summe aller periodisch erhobenen Kosten und Kommissionen, die dem Nettovermögen belastet werden, und zwar rückwirkend als Prozentsatz vom durchschnittlichen Nettovermögen.

Falls ein Subfonds mindestens 10% des Nettovermögens in Zielfonds investiert wird eine zusammengesetzte TER des Dachfonds wie folgt berechnet.

Diese TER entspricht der Summe der anteilmäßigen TER der einzelnen Zielfonds, gewichtet nach deren Anteil am Nettofondsvermögen und der TER per Stichtag des Dachfonds, abzüglich der in der Berichtsperiode vereinnahmten Retrozessionen von Zielfonds. Die TER wird nach der SFAMA Richtlinie berechnet.

Für Aktienklassen, die weniger als 6 Monate vor Abschluss aufgelegt wurden, wird keine TER ausgewiesen.

Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestandes

Der Bericht über alle während der Berichtsperiode eingetretenen Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestandes kann von den Anlegern am Sitz der Gesellschaft oder der lokalen Vertreter in den Ländern, in welchen die Gesellschaft registriert ist, kostenlos bezogen werden.

Wechselkurse

Der konsolidierte Bericht wird in USD erstellt. Zu diesem Zweck wird der Bericht der Subfonds in USD, zu den Wechselkursen vom 31.05.2016 umgerechnet:

1 USD = 0,898271 EUR
1 USD = 110,905008 JPY

Fondsperformance

(siehe Detail auf Subfondsebene)

Die Performance des Jahres N basiert auf den zu Jahresbeginn errechneten Nettoinventarwerten des Jahres N respektive N+1, die auf Basis der Marktpreise der Investitionen zum Jahresende des Jahres N-1 respektive N ermittelt wurden. Die YTD (Year-To-Date) Performanceberechnung beinhaltet die Periode vom 01.01.2016 bis zum 31.05.2016.

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar.

Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Aktien erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Die Performance ausschüttender Anteile beinhaltet die Wiederanlagen der Dividenden.

Bei Aktien, deren Ausgabe minimum 3 Jahre zurück liegt, wird die "Performance seit Auflegung" nicht dargestellt.

Die Performance wird berechnet basierend auf dem Nettovermögenswert mit Swing Faktor.

Verwaltungsgebühren der Zielfonds

ISIN	Valoren	Verwaltungs- gebühr in % (pro Jahr)
LU0858842049	Credit Suisse (Lux) Liquid Alternative Beta - DB USD -	0,00
LU0858842635	Credit Suisse (Lux) Liquid Event Driven - DB USD -	0,00
LU0858842395	Credit Suisse (Lux) Liquid Global Strategies - DB USD -	0,00
LU0858842478	Credit Suisse (Lux) Liquid Long/Short - DB USD -	0,00
LU0650600868	Credit Suisse (Lux) Money Market Fund - USD - DB -	0,00
LU0858842718	Credit Suisse Nova (Lux) Leveraged LAB - DB-	0,00

Risikomanagement

Das Gesamtrisikopotenzial der Subfonds wird nach dem Commitment-Ansatz berechnet, mit Ausnahme von Credit Suisse (Lux) Multi-Advisor Equity Alpha Fund und Credit Suisse (Lux) SystematicReturn Fund USD welche nach VaR-Ansatz berechnet werden.

1. Information zu VaR

Die in der untenstehenden Tabelle erwähnten Fonds folgen für die Berechnung ihres Gesamtrisikopotenzials dem absoluten VaR-Ansatz. Die im Rechnungsjahr erreichten VaR-Niveaus und die VaR-Grenze werden in der nachstehenden Tabelle für jeden Fonds aufgeführt:

Fund Name	VaR Minimum	VaR Durchschnitt	VaR Maxi.	Marktrisiko interne Limite	Regulatorische Limite
Credit Suisse (Lux) Multi-Advisor Equity Alpha Fund	2,25%	3,73%	6,63%	15,00%	20,00%
Credit Suisse (Lux) SystematicReturn Fund USD	1,60%	2,23%	4,52%	10,00%	20,00%

Angewendete Berechnungsstandards

Die folgenden Berechnungsstandards wurden bei der täglichen Berechnung des VaR angewendet:

■	Konfidenzniveau:	99%
■	Haltdauer:	1 Monat (20 Arbeitstage)
■	Tatsächlicher Beobachtungszeitraum:	250 Tage
■	Update des Datensatzes:	Täglich
■	Berechnungshäufigkeit:	Täglich
■	Model:	Monte-Carlo-Simulation

2. Informationen zur Hebelwirkung

Die während des Rechnungsjahres erreichten Hebelwirkungen werden in der nachstehenden Tabelle für jeden Fonds aufgeführt:

Fund Name	Methode zur Berechnung der Hebelwirkung	Minimale Hebelwirkung (*)	Vorjährige durchschnittliche Hebelwirkung	Vorjährige max. Hebelwirkung
Credit Suisse (Lux) Multi-Advisor Equity Alpha Fund	2,00%	0,24%	1,13%	1,31%
Credit Suisse (Lux) SystematicReturn Fund USD	5,00%	0,62%	1,76%	2,52%

(*) Zeitraum vom Lancierungsdatum bis 31. Mai 2016

Wie regulatorisch vorgeschrieben wird die Hebelwirkung anhand der Summe der Nominalbeträge der Derivaten berechnet. Die Summe der Nominalbeträge berücksichtigt die absoluten Werte der Nominalbeträge aller vom Subfonds eingesetzten derivativen Finanzinstrumente. Daher handelt es sich bei der Hebelwirkung um einen Indikator für die Intensität der eingesetzten derivativen Finanzinstrumente innerhalb eines Subfonds, nicht jedoch um einen Indikator für das Anlagerisiko im Zusammenhang mit diesen Derivaten, da Verrechnung- und Absicherungseffekte nicht berücksichtigt werden. Tatsächlich führen Derivate, die zur Kompensation von Risiken im Zusammenhang mit anderen Transaktionen dienen, aufgrund ihres Beitrags an die Summe der Nominalbeträge zu einem Anstieg der Hebelwirkung. Hinsichtlich des Gesamtrisikos des Subfonds sollten

Anleger die Informationen im KIID berücksichtigen. Die Hebelwirkung kann sich im Verlauf der Zeit ändern und höher sein als erwartet.

Je nach Art des Derivats können Sicherheiten (Collaterals) von verschiedenen Gegenparteien entgegengenommen werden, um das Risiko gegenüber der Gegenpartei zu minimieren. Für andere Derivatformen können Margekonten genutzt werden.

Transaktionskosten

Transaktionskosten beinhalten Brokergebühren, Stempelsteuern, lokale Steuern und andere ausländische Gebühren die im Berichtszeitraum entstanden sind. Die Transaktionsgebühren sind in den Kosten der gekauften und verkauften Wertpapiere inbegriffen.

Für das am 31.05.2016 abgeschlossenen Geschäftsperiode erhob der Fonds Transaktionskosten im Zusammenhang mit dem Kauf oder Verkauf von Wertpapieren und ähnlichen Geschäften (einschliesslich derivativer Finanzinstrumente oder anderen geeigneten Anlagen) wie folgt:

Credit Suisse (Lux) CS AllHedge Index Fund	USD	0,00
Credit Suisse (Lux) Fund of Liquid Alternative Beta Funds	USD	0,00
Credit Suisse (Lux) FundSelection Balanced EUR	EUR	50.850,83
Credit Suisse (Lux) FundSelection Yield EUR	EUR	69.121,84
Credit Suisse (Lux) Global Emerging Market Brands Equity Fund	USD	177.302,38
Credit Suisse (Lux) Global High Income Fund USD	USD	11.747,19
Credit Suisse (Lux) Multi-Advisor Equity Alpha Fund	USD	87.272,91
Credit Suisse (Lux) Multimanager Emerging Markets Equity Fund	USD	0,00
Credit Suisse (Lux) Multimanager Enhanced Fixed Income USD Fund	USD	13.727,25
Credit Suisse (Lux) Prima Growth Fund	EUR	0,08
Credit Suisse (Lux) Prima Multi-Strategy Fund	EUR	10.839,18
Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund	USD	262.669,03
Credit Suisse (Lux) SystematicReturn Fund USD	USD	7.576,94

Nicht alle Transaktionskosten sind einzeln identifizierbar. Bei festverzinslichen Anlagen, Devisenterminkontrakten und einigen anderen Derivatkontrakten sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis der Anlage eingeschlossen. Obwohl nicht einzeln identifizierbar werden die Transaktionskosten in der Performance der einzelnen Subfonds erfasst.

Wertpapierleihgeschäfte

Am 31.05.2016 waren die Subfonds nicht an den Wertpapierleihgeschäften mit Credit Suisse AG folgendermaßen beteiligt:

Subfond	Währung	Wertpapierleih-Geschäfte-bewertung	Garantie-depot-bewertung
Credit Suisse (Lux) Global High Income Fund USD	USD	3.615.896	3.880.695
Credit Suisse (Lux) Multi-Advisor Equity Alpha Fund	USD	1.514.602	1.625.519
Credit Suisse (Lux) Multimanager Emerging Markets Equity Fund	USD	3.106.310	3.333.791
Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund	USD	261.057	280.175
Credit Suisse (Lux) SystematicReturn Fund USD	USD	6.942.569	7.450.987

Die von der Securities-Lending-Gegenpartei gestellten Sicherheiten für die Gesellschaft umfassen ein gut diversifiziertes Wertpapierportfolio:

- das aus Anleihen mit hohem Rating besteht, die entweder von Staaten, staatlichen Sonderinstitutionen, öffentlichem Recht unterstehenden Körperschaften oder Unternehmen (ausgenommen Tochtergesellschaften der Credit Suisse) aus ausgewählten OECD-Ländern ausgegeben oder garantiert werden.
 - Anleihen mit hohem Rating von supranationalen Organisationen
 - an ausgewählten Börsen innerhalb der OECD notierte Aktien, unter der Voraussetzung, dass sie in einem liquiden Hauptindex gelistet sind
- Bei der Ermittlung des Marktwerts der Sicherheiten werden angemessene Haircuts vorgenommen, angepasst an die Volatilität des Sicherheitentyps.

Die Erträge, die in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens unter «Erträge aus Wertpapierleihgeschäften» aufgeführt sind,

sind Nettobeträge, die vom Lending Principal erhalten wurden. Sämtliche direkten und indirekten operationellen Kosten und Gebühren werden vom Principal aus dieser Gebühr beglichen und beinhalten das vom Principal getragene Haftungsrisiko.

Für das am 31.05.2016 abgeschlossene Geschäftsperiode war die Gebühr, die an den Principal gezahlt wurde, wie folgt:

Subfonds	Währung	Bruttobetrag Wertpapierleihe	Aufwendungen und Kommissionen des Beauftragten für Wertpapierleihgeschäfte	Nettobetrag
Credit Suisse (Lux) FundSelection Balanced EUR	EUR	2.167,17	866,87	1.300,30
Credit Suisse (Lux) FundSelection Yield EUR	EUR	3.919,85	1.567,94	2.351,91
Credit Suisse (Lux) Global High Income Fund USD	USD	32.572,63	13.029,05	19.543,58
Credit Suisse (Lux) Multi-Advisor Equity Alpha Fund	USD	1.616,87	646,75	970,12
Credit Suisse (Lux) Multimanager Emerging Markets Equity Fund	USD	12.346,47	4.938,59	7.407,88
Credit Suisse (Lux) Multimanager Enhanced Fixed Income USD Fund	USD	2.506,55	1.002,62	1.503,93
Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund	USD	11.596,32	4.638,53	6.957,79

Gegenpartei: Credit Suisse AG, Zürich

Derivative Finanzinstrumente

Der Subfonds kann Derivatgeschäfte zur Steigerung der Effizienz des Portfolio-Managements tätigen. Details der Derivate werden unter Erläuterungen angezeigt.

Je nach Art des Derivats können Sicherheiten (Collaterals) von verschiedenen Gegenparteien entgegengenommen werden, um das Risiko gegenüber der Gegenpartei zu minimieren. Für andere Derivatformen können Margekonten genutzt werden.

Per 31.05.2016 kein Subfonds hatte Sicherheiten angenommen um das Gegenparteirisiko zu mindern.

“Tracking error” gegenüber Index

Die “Tracking error” am Ende der Periode beträgt für Credit Suisse (Lux) Fund of Liquid Alternative Beta Funds auf 0,02%.

Absicherung des Investment Portfolios

Per 31.05.2016 war das Währungsrisiko des Rentenportfolios vollständig gegen die Referenzwährung des Credit Suisse (Lux) Risk Appetite Fund abgesichert.

Nachfolgende Ereignisse

Am 25.07.2016 werden CS Investment Funds 2 – Credit Suisse (Lux) Liquid Alternative Beta, CS Investment Funds 2 – Credit Suisse (Lux) Liquid Global Strategies, CS Investment Funds 2 – Credit Suisse (Lux) Liquid Long/Short, CS Investment Funds 2 – Credit Suisse (Lux) Liquid Event Driven und Credit Suisse Nova (Lux) – Leveraged LAB in CS Investment Funds 4 - Credit Suisse (Lux) Fund of Liquid Alternative Beta Funds fusioniert.

Am 25.07.2016 wird CS Investment Funds 4 - Credit Suisse (Lux) Fund of Liquid Alternative Beta Funds in CS Investment Funds 4 - Credit Suisse (Lux) Liquid Alternative Beta umbenannt.

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens in USD

Für die Periode vom
01.12.2015 bis zum
31.03.2016

Nettovermögen zu Beginn der Periode	46.842.267,16
Erträge	
Bankzinsen	872,86
Andere Erträge	320,68
	1.193,54
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	77.611,48
Depotbank- und Depotgebühr	2.486,33
Verwaltungskosten	11.328,81
Druck- und Veröffentlichungskosten	2.231,94
Zinsen und Bankspesen	8,84
Kosten für Revision, Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	94.001,62
"Taxe d'abonnement"	2.045,29
	189.714,31
Nettoerträge (-verluste)	-188.520,77
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	158.433,74
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	-413.207,06
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-1.802.436,65
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	110.747,32
	-1.946.462,65
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-2.134.983,42
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-318.444,13
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-1.984.359,96
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	2.786.036,97
	483.232,88
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	-1.651.750,54
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	1.536.967,25
Rücknahmen	-46.727.483,87
	-45.190.516,62
Nettovermögen am Ende der Periode	0,00

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
FB -Thesaurierend	USD	19962726	LU0853133634	0,70%	1,03%
FBH -Thesaurierend	CHF	19962934	LU0853132586	0,70%	1,03%
FBH -Thesaurierend	EUR	19962940	LU0853132669	0,70%	1,03%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2015	2014	2013
FB -Thesaurierend	USD	0,17%	/	-0,75%	3,20%	7,35%
FBH -Thesaurierend	CHF	-0,45%	/	-1,66%	2,76%	6,80%
FBH -Thesaurierend	EUR	-0,25%	/	-1,13%	2,97%	6,99%

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in USD)
EUR	29.960,00	USD	-33.612,24	15.06.2016	-246,15
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
CHF	38.148,00	USD	-39.040,39	15.06.2016	-647,02
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
EUR	264.104.197,00	USD	-294.180.689,59	15.06.2016	-51.014,64
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
CHF	399.262.550,00	USD	-406.681.589,14	15.06.2016	-4.850.982,41
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	120.624,34	CHF	-118.394,00	15.06.2016	1.468,07
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	56.765,08	EUR	-50.957,00	15.06.2016	14,87
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
EUR	148.212,00	USD	-164.983,33	22.06.2016	106,90
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	321.525,17	CHF	-316.338,00	22.06.2016	3.062,82
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	149.866,13	CHF	-148.015,00	15.06.2016	898,71
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	54.965,22	EUR	-49.500,00	15.06.2016	-162,27
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	50.311,48	EUR	-44.308,00	15.06.2016	965,81
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
CHF	21.557,00	USD	-22.405,00	15.06.2016	-709,35
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	366.701,98	CHF	-354.260,00	15.06.2016	10.157,65
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	314.997,47	EUR	-278.571,00	15.06.2016	4.754,42
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
EUR	4.266,00	USD	-4.809,70	15.06.2016	-58,71
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
EUR	1.638.325,00	USD	-1.847.538,77	22.06.2016	-22.642,96
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
CHF	4.725,00	USD	-4.896,29	22.06.2016	-139,59
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					

Technische Daten und Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in USD)
USD	30.848,36	CHF	-29.880,00	15.06.2016	775,73
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	183.737,10	EUR	-163.209,00	15.06.2016	1.972,42
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	586.655,05	CHF	-569.792,00	15.06.2016	13.190,81
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	34.277,48	EUR	-30.569,00	15.06.2016	233,06
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
EUR	133.970,00	USD	-149.957,67	15.06.2016	-756,89
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
CHF	2.936,00	USD	-3.018,80	15.06.2016	-63,92
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	3.094.662,24	CHF	-3.013.687,00	15.06.2016	61.557,32
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	410.254,72	EUR	-364.820,00	15.06.2016	3.957,50
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
CHF	2.328,00	USD	-2.396,96	15.06.2016	-53,99
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	173.160,74	EUR	-152.424,00	15.06.2016	3.406,62
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	58.419,94	CHF	-56.172,00	15.06.2016	1.885,57
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
CHF	862.644,00	USD	-903.271,34	15.06.2016	-35.078,81
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
EUR	169.452,00	USD	-193.238,01	15.06.2016	-4.521,35
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
EUR	144.351,00	USD	-164.333,77	15.06.2016	-3.571,79
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
CHF	7.769,00	USD	-8.128,17	15.06.2016	-309,20
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	620.114,44	EUR	-543.426,00	15.06.2016	14.901,56
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	121.802,49	EUR	-106.754,00	15.06.2016	2.910,69
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	58.674,66	CHF	-56.050,00	15.06.2016	2.262,84
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	208.806,51	EUR	-182.875,00	15.06.2016	5.138,80
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	327.397,48	CHF	-312.475,00	15.06.2016	12.905,22
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	183.329,77	CHF	-174.630,00	15.06.2016	7.572,19
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	269.043,51	EUR	-235.770,00	15.06.2016	6.466,74
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	225.989,31	EUR	-197.469,00	15.06.2016	6.068,07
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	231.804,06	CHF	-220.470,00	15.06.2016	9.910,27
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	24.896,08	EUR	-21.704,00	15.06.2016	724,31
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	101.625,29	CHF	-96.510,00	15.06.2016	4.491,94
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	263.402,42	CHF	-251.807,00	15.06.2016	9.970,07
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					

Technische Daten und Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in USD)
USD	147.117,89	EUR	-129.014,00	15.06.2016	3.435,20
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	106.781,53	EUR	-94.345,00	15.06.2016	1.709,96
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	117.306,39	CHF	-112.975,00	15.06.2016	3.602,68
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	96.732,74	CHF	-93.177,00	15.06.2016	2.954,75
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
CHF	5.009.228,00	USD	-5.200.385,86	15.06.2016	-158.938,51
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	134.113,00	EUR	-118.751,00	15.06.2016	1.860,71
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
EUR	3.532.950,00	USD	-3.989.983,36	15.06.2016	-55.379,34
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	121.509,91	EUR	-107.398,00	15.06.2016	1.901,30
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	170.817,82	CHF	-164.726,00	15.06.2016	5.029,45
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
EUR	2.171.327,00	USD	-2.459.300,76	15.06.2016	-41.119,94
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	216.498,61	CHF	-208.479,00	15.06.2016	6.674,88
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	942.497,48	CHF	-904.830,00	15.06.2016	31.829,44
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	174.151,03	EUR	-152.951,00	15.06.2016	3.809,84
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
CHF	5.592,00	USD	-5.800,20	15.06.2016	-172,23
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	293.052,70	EUR	-258.099,00	15.06.2016	5.608,73
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	21.693,14	EUR	-19.151,00	15.06.2016	364,76
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	79.235,07	CHF	-76.921,00	15.06.2016	1.818,31
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	173.767,33	EUR	-154.189,00	15.06.2016	2.048,09
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	69.877,27	CHF	-68.195,00	15.06.2016	1.242,96
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	77.585,73	CHF	-75.502,00	15.06.2016	1.597,21
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	152.336,63	EUR	-134.867,00	15.06.2016	2.136,03
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	34.431,10	CHF	-33.410,00	15.06.2016	805,76
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	242.024,30	EUR	-213.639,00	15.06.2016	4.095,50
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	289.575,27	EUR	-255.534,00	15.06.2016	4.988,16
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	97.609,43	CHF	-94.873,00	15.06.2016	2.125,02
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	143.597,34	EUR	-126.587,00	22.06.2016	2.593,27
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
CHF	132.162,00	USD	-136.804,95	22.06.2016	-3.756,41
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					

Technische Daten und Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in USD)
USD	2.290.111,03	EUR	-1.996.154,00	22.06.2016	66.599,38
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	266.132,63	CHF	-254.924,00	22.06.2016	9.490,56
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	151.607,16	EUR	-131.496,00	15.06.2016	5.159,61
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	209.195,33	CHF	-199.747,00	15.06.2016	8.158,86
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	372.132,89	CHF	-354.531,00	15.06.2016	15.312,73
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	47.408,28	EUR	-41.095,00	15.06.2016	1.640,63
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
CHF	84.782,00	USD	-88.761,01	15.06.2016	-3.433,69
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	400.333,25	EUR	-347.803,00	15.06.2016	12.984,11
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	3.142.428,27	EUR	-2.751.251,00	15.06.2016	78.362,22
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	4.353.176,97	CHF	-4.220.207,00	15.06.2016	105.766,42
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	408.367,71	CHF	-395.984,00	15.06.2016	9.831,24
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	370.760,07	EUR	-324.580,00	15.06.2016	9.275,57
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	131.086,92	CHF	-127.626,00	15.06.2016	2.638,58
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
EUR	25.744,00	USD	-29.375,99	15.06.2016	-705,21
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	420.325,26	EUR	-367.135,00	15.06.2016	11.446,92
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
CHF	261.644,00	USD	-270.010,85	15.06.2016	-6.683,96
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	215.141,76	EUR	-188.570,00	15.06.2016	5.131,59
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	103.241,35	CHF	-100.047,00	15.06.2016	2.549,42
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
CHF	2.792.676,00	USD	-2.865.753,58	15.06.2016	-55.115,09
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
EUR	24.748,00	USD	-27.954,06	15.06.2016	-392,51
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	156.844,22	CHF	-153.074,00	15.06.2016	2.784,13
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	9.600,47	EUR	-8.458,00	15.06.2016	180,83
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	251.168,44	EUR	-222.341,00	15.06.2016	3.548,54
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
CHF	8.203,00	USD	-8.374,07	15.06.2016	-118,31
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	375.328,56	CHF	-371.378,00	15.06.2016	1.561,30
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	55.465,99	EUR	-49.419,00	15.06.2016	428,48
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	313.122,74	EUR	-279.418,00	15.06.2016	1.937,50
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					

Technische Daten und Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in USD)
USD	428.487,10	CHF	-425.061,00	15.06.2016	692,12
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	93.870,35	CHF	-93.059,00	15.06.2016	212,76
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	404.347,54	EUR	-360.482,00	15.06.2016	2.881,93
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
CHF	34.721,00	USD	-35.037,84	15.06.2016	-93,51
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	46.152,16	EUR	-41.309,00	15.06.2016	146,76
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	262.223,52	CHF	-259.970,00	15.06.2016	581,31
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
EUR	55.117,00	USD	-61.416,90	15.06.2016	-33,76
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
EUR	162.556,00	USD	-181.762,84	15.06.2016	-726,17
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	914.456,27	CHF	-905.532,00	15.06.2016	3.098,94
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
EUR	67.408,00	USD	-75.045,18	15.06.2016	26,30
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	48.589,53	CHF	-48.221,00	15.06.2016	58,39
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	204.613,30	CHF	-203.343,00	15.06.2016	-37,38
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
USD	39.396,12	EUR	-35.332,00	15.06.2016	47,28
<i>Morgan Stanley Capital Services - NY</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-4.651.167,67

Nettovermögensaufstellung in USD und Fondsentwicklung

	31.05.2016
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	883.872.391,10
Bankguthaben und sonstige	12.947.081,35
Forderungen aus Zeichnungen	1.201.601,51
Gründungskosten	24.117,44
	898.045.191,40
Passiva	
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	1.647.517,97
Rückstellungen für Aufwendungen	732.209,17
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	4.651.167,67
Andere Passiva	167,03
	7.031.061,84
Nettovermögen	891.014.129,56

Fondsentwicklung		31.05.2016	30.11.2015	30.11.2014
Fondsvermögen	USD	891.014.129,56	940.919.588,69	1.009.190.778,78
Nettoinventarwert pro Aktie				
FB -Thesaurierend	USD	1.103,56	1.119,13	1.111,02
FBH -Thesaurierend	CHF	1.083,16	1.106,97	1.108,28
FBH -Thesaurierend	EUR	1.095,91	1.116,74	1.112,63

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Periode	zu Beginn der Periode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
FB -Thesaurierend	USD	180.954,199	206.062,014	12.713,260	37.821,075
FBH -Thesaurierend	CHF	365.604,752	376.302,984	34.484,963	45.183,195
FBH -Thesaurierend	EUR	240.162,579	258.674,776	32.503,630	51.015,827

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens in USD

Für die Periode vom
01.12.2015 bis zum
31.05.2016

Nettovermögen zu Beginn der Periode	940.919.588,69
Erträge	
Bankzinsen	20.944,38
	20.944,38
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	3.199.830,68
Depotbank- und Depotgebühr	182.931,13
Verwaltungskosten	411.387,98
Druck- und Veröffentlichungskosten	40.956,14
Zinsen und Bankspeisen	191,15
Kosten für Revision, Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	353.468,01
"Taxe d'abonnement"	6.932,22
Abschreibung der Gründungskosten	10.378,19
	4.206.075,50
Nettoerträge (-verluste)	-4.185.131,12
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	2.119.329,57
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-24.714.161,62
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	6.656.343,65
	-15.938.488,40
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-20.123.619,52
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-11.547.930,06
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	43.014.027,15
	31.466.097,09
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	11.342.477,57
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	90.269.170,48
Rücknahmen	-151.517.107,18
	-61.247.936,70
Nettovermögen am Ende der Periode	891.014.129,56

Geographische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestandes Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Geographische Aufteilung

Luxemburg	88,47
Liechtenstein	10,73
Total	99,20

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	99,20
Total	99,20

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Netto- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere: Investmentfonds			
Fondsanteile (Open-End)			
USD CREDIT SUISSE (LIECHTENSTEIN) MONEY MARKET FUND USD -ID-	93.084,65	95.577.457,95	10,73
USD CREDIT SUISSE (LUX) LIQUID ALTERNATIVE BETA -DB- USD	153.147,91	175.922.536,84	19,74
USD CREDIT SUISSE (LUX) LIQUID EVENT DRIVEN -DB- USD	80.998,41	87.829.008,08	9,86
USD CREDIT SUISSE (LUX) LIQUID GLOBAL STRATEGIES -DB- USD	153.755,66	174.623.379,31	19,60
USD CREDIT SUISSE (LUX) LIQUID LONG/SHORT -DB- USD	39.760,67	49.735.825,64	5,58
USD CREDIT SUISSE NOVA (LUX) - LEVERAGED LAB -DB-	124.741,53	178.745.886,31	20,06
USD CS INVESTMENT FUNDS 13 - CS (Lux) MONEY MARKET FUND - USD -DB-	120.156,23	121.438.296,97	13,63
Fondsanteile (Open-End)		883.872.391,10	99,20
Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere: Investmentfonds			
		883.872.391,10	99,20
Total des Wertpapierbestandes		883.872.391,10	99,20
Bankguthaben und sonstige		12.947.081,35	1,45
Andere Passiva		-5.805.342,89	-0,65
Fondsvermögen		891.014.129,56	100,00

Technische Daten und Erläuterungen**Technische Daten**

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B -Thesaurierend	EUR	22634836	LU0984159805	1,50%	2,09%
IB -Thesaurierend	EUR	24027190	LU1048951070	0,60%	1,27%
UB -Thesaurierend	EUR	26366653	LU1144420467	1,25%	1,89%
BH -Thesaurierend	CHF	22634841	LU0984159987	1,50%	2,09%
UBH -Thesaurierend	CHF	26366667	LU1144420541	1,25%	1,89%
BH -Thesaurierend	GBP	22634850	LU0984160134	1,50%	2,09%
UBH -Thesaurierend	GBP	26366728	LU1144420624	1,25%	1,89%
BH -Thesaurierend	USD	22634846	LU0984160050	1,50%	2,10%
UBH -Thesaurierend	USD	26367307	LU1144420897	1,25%	1,90%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2015	2014
B -Thesaurierend	EUR	-0,05%	15,39%	3,34%	10,13%
IB -Thesaurierend	EUR	0,29%	14,39%	4,19%	/
UB -Thesaurierend	EUR	0,04%	-0,44%	/	/
BH -Thesaurierend	CHF	-0,31%	12,98%	2,00%	9,61%
UBH -Thesaurierend	CHF	-0,19%	-1,74%	/	/
BH -Thesaurierend	GBP	0,12%	15,65%	3,35%	10,23%
UBH -Thesaurierend	GBP	0,14%	-0,34%	/	/
BH -Thesaurierend	USD	0,23%	14,76%	2,83%	9,77%
UBH -Thesaurierend	USD	0,34%	-0,61%	/	/

Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in EUR)
GBP	17.905.488,86	EUR	-23.069.514,27	15.06.2016	331.887,37
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	42.076.488,65	EUR	-38.482.422,75	15.06.2016	-458.212,24
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	48.037.448,07	EUR	-43.156.957,25	15.06.2016	-23.289,59
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	6.605.804,88	CHF	-7.225.000,00	23.09.2016	67.245,75
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	8.511.347,42	USD	-9.500.000,00	23.09.2016	6.689,81
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	3.369.000,00	EUR	-3.091.500,71	23.09.2016	-42.637,45
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	191.628,15	EUR	-176.358,35	15.06.2016	-3.185,41
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	271.566,80	EUR	-248.938,54	15.06.2016	-3.525,64
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	62.832,92	USD	-71.706,00	15.06.2016	-1.553,77
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	656.273,97	USD	-749.780,54	15.06.2016	-16.973,81
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	2.294.680,18	GBP	-1.860.596,56	15.06.2016	-137.061,12
<i>Credit Suisse Zürich</i>					

Technische Daten und Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in EUR)
CHF	354.775,85	EUR	-326.672,54	15.06.2016	-6.064,24
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	950.753,21	EUR	-841.505,59	15.06.2016	12.192,40
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	155.963,14	CHF	-170.415,00	15.06.2016	1.959,97
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
GBP	257.309,01	EUR	-324.849,08	15.06.2016	11.438,39
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	198.439,70	EUR	-181.709,70	15.06.2016	-2.381,22
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	74.232,85	EUR	-65.169,70	15.06.2016	1.485,28
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	205.170,00	EUR	-187.093,58	15.06.2016	-1.682,97
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	414.492,67	USD	-466.988,17	15.06.2016	-4.826,10
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	579.779,72	EUR	-507.800,07	15.06.2016	12.794,32
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	663.530,50	EUR	-596.471,03	15.06.2016	3.156,56
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
GBP	148.330,21	EUR	-192.297,33	15.06.2016	1.561,37
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	439.437,98	GBP	-334.988,45	15.06.2016	1.628,76
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	711.169,35	EUR	-643.351,72	15.06.2016	-673,26
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
GBP	74.304,26	EUR	-97.513,01	15.06.2016	-401,79
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-250.428,63

Nettovermögensaufstellung in EUR und Fondsentwicklung

	31.05.2016
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	368.536.636,19
Bankguthaben und sonstige	16.411.747,19
Forderungen aus Zeichnungen	274.936,52
Forderungen aus Erträgen	1.124,89
	385.224.444,79
Passiva	
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	114.243,35
Rückstellungen für Aufwendungen	506.843,43
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	250.428,63
Andere Passiva	147,07
	871.662,48
Nettovermögen	384.352.782,31

Fondsentwicklung		31.05.2016	30.11.2015	30.11.2014
Fondsvermögen	EUR	384.352.782,31	400.826.376,68	188.144.729,33
Nettoinventarwert pro Aktie				
B -Thesaurierend	EUR	115,39	118,64	111,09
IB -Thesaurierend	EUR	1.143,89	1.171,31	1.087,61
UB -Thesaurierend	EUR	99,56	102,26	/
BH -Thesaurierend	CHF	112,98	116,59	110,54
UBH -Thesaurierend	CHF	98,26	101,25	/
BH -Thesaurierend	GBP	115,65	118,63	111,15
UBH -Thesaurierend	GBP	99,66	102,17	/
BH -Thesaurierend	USD	114,76	117,66	110,79
UBH -Thesaurierend	USD	99,39	101,77	/

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Periode	zu Beginn der Periode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
B -Thesaurierend	EUR	2.163.895,217	2.190.013,717	166.281,522	192.400,022
IB -Thesaurierend	EUR	10.788,519	10.625,313	163,206	0,000
UB -Thesaurierend	EUR	167.792,240	141.052,636	33.203,419	6.463,815
BH -Thesaurierend	CHF	303.581,433	301.230,324	30.037,539	27.686,430
UBH -Thesaurierend	CHF	107.773,247	75.890,821	35.997,426	4.115,000
BH -Thesaurierend	GBP	109.105,621	135.016,421	1.028,848	26.939,648
UBH -Thesaurierend	GBP	37.328,617	31.640,216	5.913,335	224,934
BH -Thesaurierend	USD	396.263,359	411.648,660	25.327,989	40.713,290
UBH -Thesaurierend	USD	31.967,888	14.535,678	18.418,337	986,127

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens in EUR

Für die Periode vom
01.12.2015 bis zum
31.05.2016

Nettovermögen zu Beginn der Periode	400.826.376,87
Erträge	
Dividenden (Netto)	225.393,14
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	1.300,30
Andere Erträge	98.142,26
	324.835,70
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	2.522.667,50
Depotbank- und Depotgebühr	84.883,41
Verwaltungskosten	113.147,44
Druck- und Veröffentlichungskosten	20.439,16
Zinsen und Bankspesen	7.931,92
Kosten für Revision, Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	51.408,14
"Taxe d'abonnement"	24.686,30
	2.825.163,87
Nettoerträge (-verluste)	-2.500.328,17
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	594.573,60
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-214.924,47
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	220.321,62
	599.970,75
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-1.900.357,42
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-10.102.015,42
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-4.545.402,52
	-14.647.417,94
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	-16.547.775,36
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	33.476.858,89
Rücknahmen	-33.402.677,90
	74.180,99
Nettovermögen am Ende der Periode	384.352.782,31

Geographische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestandes Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Geographische Aufteilung

Luxemburg	76,70
Irland	19,18
Total	95,88

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	95,88
Total	95,88

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Netto- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere: Investmentfonds			
Fondsanteile (Open-End)			
JPY ABERDEEN JAPANESE EQUITY FUND -I2-	9.900,00	7.736.701,88	2,01
EUR ALLIANZ GLOBAL INVESTORS FUND SICAV - ALLIANZ RCM EUROLAND EQUITY GROWTH - PT2- EUR	14.305,44	13.589.019,77	3,54
EUR AVIVA INVESTORS SICAV - GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -A- EUR	110.000,00	1.992.683,00	0,52
USD AXA FIIS US SHORT DURATION HIGH YIELD -A-	51.000,00	8.076.622,50	2,10
EUR AXA WORLD FUNDS SICAV - GLOBAL INFLATION BONDS -I-	26.000,00	3.879.200,00	1,01
EUR BLACKROCK GLOBAL FUNDS - EURO MARKETS FUND -I2-	600.000,00	16.440.000,00	4,28
EUR BLACKROCK GLOBAL FUNDS SICAV - EURO BOND FUND -I2-	1.281.000,00	17.844.330,00	4,64
EUR BLACKROCK GLOBAL FUNDS SICAV - EURO SHORT DURATION BOND FUND -I2- EUR	1.150.000,00	18.722.000,00	4,87
EUR BNY MELLON GLOBAL - EUROLAND BOND FUND -S-	9.000.000,00	9.945.900,00	2,59
USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITYALLOCATION FUND -EB- USD	34.700,00	18.900.239,84	4,92
EUR CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND -EBH- EUR	2.800,00	3.299.968,00	0,86
EUR CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL INFLATION LINKED BOND FUND FBH EUR	25.000,00	3.500.250,00	0,91
EUR CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND -EBH- EUR	7.800,00	8.331.648,00	2,17
EUR DB XTRACKERS II SICAV - IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF -1C-	110.000,00	15.643.100,00	4,07
EUR DB X-TRACKERS SICAV - DAX ETF -1C-	110.430,00	11.087.172,00	2,88
USD FIDELITY FUDS SICAV EMERGING ASIA FUND -A-	860.000,00	10.058.118,12	2,62
EUR FTSE EPRA EUROZONE THEAM EASY UCITS ETF FCP	44.000,00	10.361.560,00	2,70
USD ISHARES III MSCI AUSTRALIA	85.000,00	2.110.069,17	0,55
USD ISHARES NASDAQ 100 UCITS ETF	22.000,00	4.907.686,49	1,28
EUR JO HAMBRO CAPITAL MANAGEMENT UMBRELLA FUND - CONTINENTAL EUROPEAN FUND	3.900.000,00	12.534.600,00	3,26
EUR JUPITER GLOBAL FUND - EUROPEAN GROWTH -I-	280.000,00	10.166.800,00	2,65
EUR NORDEA 1 SICAV- EUROPEAN HIGH YIELD BOND FUND -BI-	190.000,00	6.087.600,00	1,58
USD PICTET GLOBAL EMERGING DEBT -I-	23.000,00	7.766.386,71	2,02
EUR PIONEER FUNDS FCP - EURO AGGREGATE BOND -I-	12.000,00	19.557.120,00	5,09
USD RAM SYSTEMATIC FUNDS - EMERGING MKTS EQUITIES -B-	102.220,00	13.285.615,81	3,46
USD ROBECO CAPITAL GROWTH FUNDS - ROBECO US SELECT OPPORTUNITIES EQUITIES -I- USD	46.500,00	8.831.345,16	2,30
EUR SCHRODER INTERNATIONAL SELECTION FUND SICAV - EURO CORPORATE BOND -C-	590.000,00	13.233.582,00	3,44
GBP SPDR FTSE UK ALL SHARES ETF GBP	80.000,00	4.087.075,90	1,06
AUD STATE STREET GLOBAL ADVISORS LUXEMBOURG SICAV - STATE STREET AUSTRALIA INDEX EQUITY	679.888,00	4.809.286,56	1,25
CAD STATE STREET GLOBAL ADVISORS LUXEMBOURG SICAV - STATE STREET CANADA INDEX EQUITY	561.784,01	4.086.122,70	1,06
CHF STATE STREET GLOBAL ADVISORS LUXEMBOURG SICAV - STATE STREET SWITZERLAND INDEX EQUITY	709.999,50	6.499.048,55	1,69
USD VANGUARD FUND PLC - S&P 500 EXCHANGE TRADED FUND	670.000,00	24.025.510,89	6,24
EUR VANGUARD INVESTMENT SERIES - VANGUARD EUROZONE STOCK INDEX FUND -EUR-	150.000,00	16.159.800,00	4,20
EUR VONTOBEL FUND SICAV - EUR CORPORATE BOND MID YIELD -I-	135.000,00	20.787.300,00	5,41
USD WELLINGTON MGT PORTFOLIO US RESEARCH -S-	155.000,00	10.193.173,14	2,65
Fondsanteile (Open-End)		368.536.636,19	95,88
Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere: Investmentfonds			
		368.536.636,19	95,88
Total des Wertpapierbestandes		368.536.636,19	95,88
Bankguthaben und sonstige		16.411.747,19	4,27
Andere Passiva		-595.601,07	-0,15
Fondsvermögen		384.352.782,31	100,00

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B -Thesaurierend	EUR	22635922	LU0984160217	1,30%	1,85%
IB -Thesaurierend	EUR	24027192	LU1048951153	0,60%	1,25%
UB -Thesaurierend	EUR	26368451	LU1144420970	1,05%	1,66%
BH -Thesaurierend	CHF	22635925	LU0984160308	1,30%	1,85%
UBH -Thesaurierend	CHF	26368560	LU1144421192	1,05%	1,65%
BH -Thesaurierend	GBP	22635938	LU0984160563	1,30%	1,85%
UBH -Thesaurierend	GBP	26369262	LU1144421275	1,05%	1,67%
BH -Thesaurierend	USD	22635930	LU0984160480	1,30%	1,85%
UBH -Thesaurierend	USD	26369836	LU1144421358	1,05%	1,66%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2015	2014
B -Thesaurierend	EUR	1,07%	12,92%	1,49%	9,49%
IB -Thesaurierend	EUR	1,33%	8,87%	2,13%	/
UB -Thesaurierend	EUR	1,16%	-0,53%	/	/
BH -Thesaurierend	CHF	0,78%	10,49%	0,11%	9,00%
UBH -Thesaurierend	CHF	0,87%	-1,86%	/	/
BH -Thesaurierend	GBP	1,22%	13,47%	1,70%	9,65%
UBH -Thesaurierend	GBP	1,34%	-0,16%	/	/
BH -Thesaurierend	USD	1,36%	12,70%	1,29%	9,16%
UBH -Thesaurierend	USD	1,52%	-0,36%	/	/

Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in EUR)
GBP	13.999.227,53	EUR	-18.036.669,20	15.06.2016	259.482,82
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	83.274.889,60	EUR	-76.161.761,83	15.06.2016	-906.862,14
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	51.374.617,61	EUR	-46.155.078,27	15.06.2016	-24.907,52
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	10.121.281,66	CHF	-11.070.000,00	23.09.2016	103.032,60
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	21.412.758,24	USD	-23.900.000,00	23.09.2016	16.830,15
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	212.641,79	GBP	-166.755,00	15.06.2016	-5.299,05
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	4.808.000,00	EUR	-4.411.972,52	23.09.2016	-60.849,17
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	249.394,75	EUR	-229.187,31	15.06.2016	-3.811,13
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	1.089.448,27	EUR	-969.115,18	15.06.2016	9.119,54
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	619.269,38	USD	-703.281,32	15.06.2016	-12.224,06
<i>Credit Suisse Zürich</i>					

Technische Daten und Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in EUR)
USD	1.216.490,00	EUR	-1.065.674,66	15.06.2016	26.633,06
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	923.031,90	GBP	-741.324,60	15.06.2016	-45.852,69
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	58.442,70	EUR	-51.727,26	15.06.2016	749,47
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	1.742.006,40	EUR	-1.589.500,23	15.06.2016	-15.261,98
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	1.067.832,78	EUR	-944.750,66	15.06.2016	14.075,13
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	1.270.429,48	GBP	-987.536,00	15.06.2016	-20.228,76
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
GBP	402.431,38	EUR	-520.410,17	15.06.2016	5.543,54
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	891.442,75	USD	-999.338,52	15.06.2016	-5.883,16
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
GBP	82.162,37	EUR	-108.007,96	15.06.2016	-626,66
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	187.499,76	GBP	-142.984,80	15.06.2016	627,43
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-665.712,58

Nettovermögensaufstellung in EUR und Fondsentwicklung

	31.05.2016
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	614.174.572,95
Bankguthaben und sonstige	18.286.583,30
Forderungen aus Zeichnungen	701.300,99
Forderungen aus Erträgen	3.795,56
	633.166.252,80
Passiva	
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	957.873,76
Rückstellungen für Aufwendungen	730.759,50
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	665.712,58
Andere Passiva	601,59
	2.354.947,43
Nettovermögen	630.811.305,37

Fondsentwicklung		31.05.2016	30.11.2015	30.11.2014
Fondsvermögen	EUR	630.811.305,37	625.460.739,97	357.357.189,35
Nettoinventarwert pro Aktie				
B -Thesaurierend	EUR	112,92	113,96	109,54
IB -Thesaurierend	EUR	1.088,71	1.095,32	1.046,19
UB -Thesaurierend	EUR	99,47	100,28	/
BH -Thesaurierend	CHF	110,49	111,94	109,02
UBH -Thesaurierend	CHF	98,14	99,32	/
BH -Thesaurierend	GBP	113,47	114,27	109,67
UBH -Thesaurierend	GBP	99,84	100,39	/
BH -Thesaurierend	USD	112,70	113,39	109,25
UBH -Thesaurierend	USD	99,64	100,09	/

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Periode	zu Beginn der Periode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
B -Thesaurierend	EUR	3.865.500,075	3.884.753,827	442.666,655	461.920,407
IB -Thesaurierend	EUR	22.425,809	8.162,509	14.263,300	0,000
UB -Thesaurierend	EUR	284.053,823	238.691,147	57.466,547	12.103,871
BH -Thesaurierend	CHF	661.566,943	688.514,316	38.729,722	65.677,095
UBH -Thesaurierend	CHF	121.295,798	96.422,837	39.113,795	14.240,834
BH -Thesaurierend	GBP	77.908,476	100.157,249	515,530	22.764,303
UBH -Thesaurierend	GBP	37.200,272	27.285,401	9.914,871	0,000
BH -Thesaurierend	USD	454.450,910	450.920,591	60.514,184	56.983,865
UBH -Thesaurierend	USD	27.246,972	15.009,249	12.387,723	150,000

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens in EUR

Für die Periode vom
01.12.2015 bis zum
31.05.2016

Nettovermögen zu Beginn der Periode	625.460.739,97
Erträge	
Dividenden (Netto)	270.509,28
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	2.351,91
Andere Erträge	100.629,30
	373.490,49
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	3.534.386,29
Depotbank- und Depotgebühr	139.172,91
Verwaltungskosten	185.601,59
Druck- und Veröffentlichungskosten	31.193,17
Zinsen und Bankspesen	12.909,64
Kosten für Revision, Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	80.304,12
"Taxe d'abonnement"	26.664,97
	4.010.232,69
Nettoerträge (-verluste)	-3.636.742,20
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	412.401,41
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	314.331,72
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	365.293,21
	1.092.026,34
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-2.544.715,86
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-4.155.168,88
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-4.300.627,71
	-8.455.796,59
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	-11.000.512,45
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	85.117.100,16
Rücknahmen	-68.766.022,31
	16.351.077,85
Nettovermögen am Ende der Periode	630.811.305,37

Geographische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestandes

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Geographische Aufteilung

Luxemburg	83,64
Irland	13,72
Total	97,36

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	97,36
Total	97,36

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Netto- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere: Investmentfonds			
Fondsanteile (Open-End)			
JPY ABERDEEN JAPANESE EQUITY FUND -I2-	7.700,00	6.017.434,80	0,95
EUR ALLIANZ GLOBAL INVESTORS FUND SICAV - ALLIANZ RCM EUROLAND EQUITY GROWTH - PT2- EUR	12.672,04	12.037.423,29	1,91
EUR AVIVA INVESTORS SICAV - GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -A- EUR	350.000,00	6.340.355,00	1,01
USD AXA FIIS US SHORT DURATION HIGH YIELD -A-	126.000,00	19.954.008,53	3,16
EUR AXA WORLD FUNDS SICAV - GLOBAL INFLATION BONDS -I-	62.000,00	9.250.400,00	1,47
EUR BLACKROCK GLOBAL FUNDS - EURO MARKETS FUND -I2-	610.000,00	16.714.000,00	2,65
EUR BLACKROCK GLOBAL FUNDS SICAV - EURO BOND FUND -I2-	3.015.000,00	41.998.950,00	6,66
EUR BLACKROCK GLOBAL FUNDS SICAV - EURO SHORT DURATION BOND FUND -I2- EUR	3.270.000,00	53.235.600,00	8,43
EUR BNY MELLON GLOBAL - EUROLAND BOND FUND -S-	22.000.000,00	24.312.200,00	3,85
USD CREDIT SUISSE (LUX) COMMODITYALLOCATION FUND -EB- USD	57.800,00	31.482.243,88	4,99
EUR CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL BALANCED CONVERTIBLE BOND FUND -EBH- EUR	5.500,00	6.482.080,00	1,03
EUR CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL INFLATION LINKED BOND FUND FBH EUR	45.000,00	6.300.450,00	1,00
EUR CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND -EBH- EUR	20.800,00	22.217.728,00	3,52
EUR DB XTRACKERS II SICAV - IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE YIELD PLUS 1-3 UCITS ETF -1C-	278.000,00	39.534.380,00	6,27
EUR DB X-TRACKERS SICAV - DAX ETF -1C-	111.755,00	11.220.202,00	1,78
USD FIDELITY FUDS SICAV EMERGING ASIA FUND -A-	650.000,00	7.602.066,02	1,21
EUR FTSE EPRA EUROZONE THEAM EASY UCITS ETF FCP	72.000,00	16.955.280,00	2,69
USD ISHARES III MSCI AUSTRALIA	140.000,00	3.475.408,04	0,55
USD ISHARES NASDAQ 100 UCITS ETF	16.000,00	3.569.226,53	0,57
EUR JO HAMBRO CAPITAL MANAGEMENT UMBRELLA FUND - CONTINENTAL EUROPEAN FUND	3.100.000,00	9.963.400,00	1,58
EUR JUPITER GLOBAL FUND - EUROPEAN GROWTH -I-	335.000,00	12.163.850,00	1,93
EUR NORDEA 1 SICAV- EUROPEAN HIGH YIELD BOND FUND -B-	410.000,00	13.136.400,00	2,08
EUR PICTET FUNDS (LUX) SICAV EUR LIQUIDITY -P-	25.000,00	3.435.645,00	0,54
USD PICTET GLOBAL EMERGING DEBT -I-	52.000,00	17.558.787,33	2,78
EUR PIONEER FUNDS FCP - EURO AGGREGATE BOND -I-	27.200,00	44.329.472,00	7,03
USD RAM SYSTEMATIC FUNDS - EMERGING MKTS EQUITIES -B-	80.000,00	10.397.664,50	1,65
USD ROBECO CAPITAL GROWTH FUNDS - ROBECO US SELECT OPPORTUNITIES EQUITIES -I- USD	32.000,00	6.077.484,84	0,96
EUR SCHRODER INTERNATIONAL SELECTION FUND SICAV - EURO CORPORATE BOND -C-	1.740.000,00	39.027.852,00	6,19
GBP SPDR FTSE UK ALL SHARES ETF GBP	60.000,00	3.065.306,92	0,49
AUD STATE STREET GLOBAL ADVISORS LUXEMBOURG SICAV - STATE STREET AUSTRALIA INDEX EQUITY	579.888,00	4.101.922,03	0,65
CAD STATE STREET GLOBAL ADVISORS LUXEMBOURG SICAV - STATE STREET CANADA INDEX EQUITY	458.838,00	3.337.347,39	0,53
CHF STATE STREET GLOBAL ADVISORS LUXEMBOURG SICAV - STATE STREET SWITZERLAND INDEX EQUITY	900.000,00	8.238.236,36	1,31
USD VANGUARD FUND PLC - S&P 500 EXCHANGE TRADED FUND	650.000,00	23.308.331,46	3,69
EUR VANGUARD INVESTMENT SERIES - VANGUARD EUROZONE STOCK INDEX FUND -EUR-	175.000,00	18.853.100,00	2,99
EUR VONTOBEL FUND SICAV - EUR CORPORATE BOND MID YIELD -I-	320.000,00	49.273.600,00	7,80
USD WELLINGTON MGT PORTFOLIO US RESEARCH -S-	140.000,00	9.206.737,03	1,46
Fondsanteile (Open-End)		614.174.572,95	97,36
Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere: Investmentfonds			
		614.174.572,95	97,36
Total des Wertpapierbestandes		614.174.572,95	97,36
Bankguthaben und sonstige		18.286.583,30	2,90
Andere Passiva		-1.649.850,88	-0,26
Fondsvermögen		630.811.305,37	100,00

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Technische Daten und Erläuterungen**Technische Daten**

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B -Thesaurierend	USD	11480304	LU0522191245	1,92%	2,35%
EB -Thesaurierend	USD	11480309	LU0522191674	0,70%	/
UB -Thesaurierend	USD	26419202	LU1144421432	1,15%	1,54%
BH -Thesaurierend	CHF	11480369	LU0522192300	1,92%	2,35%
UBH -Thesaurierend	CHF	26377245	LU1144421515	1,15%	1,55%
BH -Thesaurierend	EUR	11480366	LU0522192136	1,92%	2,35%
IBH -Thesaurierend	EUR	11480371	LU0522192482	0,70%	1,11%
UBH -Thesaurierend	EUR	26377254	LU1144421606	1,15%	1,55%
BH -Thesaurierend	GBP	11949965	LU0554857044	1,92%	2,34%
UBH -Thesaurierend	GBP	26419224	LU1144421788	1,15%	1,57%

Credit Suisse (Lux) Global Emerging Market Brands Equity Fund -EB- USD: der letzte NIW wurde am 10.03.2016 berechnet.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2015	2014	2013
B -Thesaurierend	USD	-1,01%	/	-14,55%	-0,60%	13,79%
EB -Thesaurierend	USD	/	/	/	0,69%	15,46%
UB -Thesaurierend	USD	-0,68%	-14,85%	/	/	/
BH -Thesaurierend	CHF	-1,74%	/	-15,64%	-0,97%	12,97%
UBH -Thesaurierend	CHF	-1,44%	-16,45%	/	/	/
BH -Thesaurierend	EUR	-1,50%	/	-14,80%	-0,82%	13,09%
IBH -Thesaurierend	EUR	-1,00%	-8,83%	-13,64%	/	/
UBH -Thesaurierend	EUR	-1,25%	-15,58%	/	/	/
BH -Thesaurierend	GBP	-1,24%	/	-14,55%	-0,55%	13,84%
UBH -Thesaurierend	GBP	-0,92%	-15,10%	/	/	/

Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
Gegenpartei					(in USD)
EUR	8.420.021,17	USD	-9.388.289,92	15.06.2016	-11.013,38
Credit Suisse Zürich					
CHF	7.763.670,30	USD	-7.910.263,29	15.06.2016	-96.657,06
Credit Suisse Zürich					
GBP	196.465,35	USD	-281.886,12	15.06.2016	4.073,71
Credit Suisse Zürich					
USD	15.447,38	CHF	-14.886,60	15.06.2016	464,76
Credit Suisse Zürich					
CHF	245.403,90	USD	-255.104,54	15.06.2016	-8.122,21
Credit Suisse Zürich					
EUR	190.945,46	USD	-216.387,99	15.06.2016	-3.734,33
Credit Suisse Zürich					
GBP	5.584,37	USD	-8.103,79	15.06.2016	24,38
Credit Suisse Zürich					
CHF	13.673,95	USD	-14.244,62	15.06.2016	-482,72
Credit Suisse Zürich					
CHF	22.018,25	USD	-23.029,21	15.06.2016	-869,34
Credit Suisse Zürich					

Technische Daten und Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in USD)
USD	253.101,78	EUR	-222.763,80	15.06.2016	5.010,44
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	168.059,39	CHF	-160.586,45	15.06.2016	6.436,35
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	414.850,90	USD	-430.703,87	15.06.2016	-13.184,65
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
GBP	4.968,17	USD	-7.029,71	15.06.2016	201,58
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	258.082,06	USD	-291.348,83	15.06.2016	-3.925,93
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	13.938,50	USD	-14.419,86	15.06.2016	-391,71
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	199.059,40	EUR	-176.446,38	15.06.2016	2.552,18
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	551,23	EUR	-479,71	15.06.2016	16,98
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	128.131,16	CHF	-121.361,35	15.06.2016	5.985,74
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	120.884,60	USD	-127.566,01	15.06.2016	-5.903,88
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	237.122,01	CHF	-226.363,05	15.06.2016	9.297,64
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	7.088,95	GBP	-4.881,84	15.06.2016	-16,68
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	207.177,88	EUR	-180.112,55	15.06.2016	6.586,12
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	30.424,76	CHF	-29.444,85	15.06.2016	790,08
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	15.721,30	USD	-16.151,38	15.06.2016	-328,96
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	217.462,59	CHF	-212.735,15	15.06.2016	3.357,32
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	18.385,40	USD	-20.713,43	15.06.2016	-237,83
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	221.705,88	EUR	-198.024,87	15.06.2016	1.167,50
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	5.992,45	GBP	-4.100,50	15.06.2016	24,07
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	43.349,04	CHF	-43.002,30	15.06.2016	70,15
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	2.454,33	EUR	-2.188,33	15.06.2016	17,21
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	27.879,40	USD	-28.137,52	15.06.2016	-78,80
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	1.407,31	USD	-1.573,52	15.06.2016	-6,22
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-98.877,49

Nettovermögensaufstellung in USD und Fondsentwicklung

	31.05.2016
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	29.138.959,52
Bankguthaben und sonstige	946.638,99
Forderungen aus Zeichnungen	5.282,26
Forderungen aus Erträgen	92.033,67
Im Voraus bezahlte Kosten	1.756,45
Andere Aktiva	12,14
	30.184.683,03
Passiva	
Bankverbindlichkeiten und sonstige	426.039,11
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	239.825,00
Rückstellungen für Aufwendungen	54.988,68
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	98.877,49
	819.730,28
Nettovermögen	29.364.952,75

Fondsentwicklung		31.05.2016	30.11.2015	30.11.2014
Fondsvermögen	USD	29.364.952,75	38.125.799,03	70.389.666,51
Nettoinventarwert pro Aktie				
B -Thesaurierend	USD	97,40	101,95	117,18
EB -Thesaurierend	USD	/	1.095,07	1.243,08
UB -Thesaurierend	USD	85,15	88,77	/
BH -Thesaurierend	CHF	90,48	95,50	111,13
UBH -Thesaurierend	CHF	83,55	87,86	/
BH -Thesaurierend	EUR	92,85	97,73	112,61
IBH -Thesaurierend	EUR	911,66	953,57	1.084,09
UBH -Thesaurierend	EUR	84,42	88,55	/
BH -Thesaurierend	GBP	88,38	92,71	106,59
UBH -Thesaurierend	GBP	84,90	88,71	/

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Periode	zu Beginn der Periode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
B -Thesaurierend	USD	118.993,859	147.110,507	2.064,677	30.181,325
EB -Thesaurierend	USD	0,000	1.605,076	0,000	1.605,076
UB -Thesaurierend	USD	4.236,293	1.148,686	3.384,478	296,871
BH -Thesaurierend	CHF	72.167,939	94.865,023	1.226,338	23.923,422
UBH -Thesaurierend	CHF	16.373,632	6.986,447	10.911,190	1.524,005
BH -Thesaurierend	EUR	87.346,988	110.163,531	196,623	23.013,166
IBH -Thesaurierend	EUR	70,444	67,186	14,524	11,266
UBH -Thesaurierend	EUR	811,079	1.088,850	712,229	990,000
BH -Thesaurierend	GBP	2.190,685	2.190,685	0,000	0,000
UBH -Thesaurierend	GBP	99,080	99,080	0,000	0,000

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens in USD

Für die Periode vom
01.12.2015 bis zum
31.05.2016

Nettovermögen zu Beginn der Periode	38.125.799,03
Erträge	
Dividenden (Netto)	162.118,35
	162.118,35
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	294.398,40
Depotbank- und Depotgebühr	7.161,85
Verwaltungskosten	15.910,42
Druck- und Veröffentlichungskosten	6.472,94
Zinsen und Bankspesen	8.455,97
Kosten für Revision, Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	19.039,06
"Taxe d'abonnement"	7.501,54
	358.940,18
Nettoerträge (-verluste)	-196.821,83
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-2.748.419,69
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-782.595,37
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	99.067,99
	-3.431.947,07
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-3.628.768,90
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	901.298,31
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	1.422.865,14
	2.324.163,45
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	-1.304.605,45
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	1.589.658,62
Rücknahmen	-9.045.899,45
	-7.456.240,83
Nettovermögen am Ende der Periode	29.364.952,75

Geographische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestandes

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Geographische Aufteilung

Südkorea	13,88
Cayman-Inseln	13,39
Brasilien	9,99
Mexiko	6,15
Taiwan	5,18
Südafrika	5,12
Hongkong	4,46
Philippinen	4,40
Türkei	3,69
Volksrepublik China	3,36
USA	3,23
Niederlande	3,13
Indonesien	2,53
Britische Jungferninseln	2,32
Vereinigtes Königreich	2,28
Indien	2,22
Portugal	2,10
Luxemburg	1,89
Frankreich	1,73
Kolumbien	1,62
Australien	1,62
Russland	1,44
Chile	1,25
Bermudas	1,23
Österreich	1,02
Total	99,23

Wirtschaftliche Aufteilung

Einzelhandel und Warenhäuser	13,98
Immobilien	9,42
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	8,65
Anlagefonds	6,85
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	6,79
Gastgewerbe und Freizeiteinrichtungen	6,50
Nahrungsmittel und Softdrinks	6,28
Diverse Dienstleistungen	5,96
Versicherungsgesellschaften	4,07
Banken und andere Kreditinstitute	3,68
Telekommunikation	3,33
Elektronik und Halbleiter	3,32
Baugewerbe und -material	3,27
Graphisches Gewerbe, Verlage und Medien	3,18
Gesundheits- und Sozialwesen	2,28
Fahrzeuge	2,22
Elektrische Geräte und Komponenten	1,85
Forstwirtschaft, Holz und Papier	1,73
Diverse Konsumgüter	1,62
Photo und Optik	1,56
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	1,53
Biotechnologie	1,15
Tabak und alkoholische Getränke	0,01
Total	99,23

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Netto- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere: Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)			
Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)			
HKD AIA GROUP	114.000,00	666.996,10	2,27
USD ALIBABA ADR	10.170,00	833.940,00	2,84
COP ALMACENES EXITO	97.000,00	477.080,30	1,62
MXN ALSEA SAB DE CV	165.000,00	628.506,74	2,14
KRW AMOREPACIFIC (new)	3.675,00	1.287.390,87	4,38
PHP AYALA LAND	719.000,00	548.878,29	1,87
USD BAIDU.COM ADR	1.700,00	303.518,00	1,03
HKD BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY	185.000,00	338.177,44	1,15
BRL BR MALLS PARTICIPACOES	234.550,00	752.101,72	2,56
HKD CHINA MOBILE	56.500,00	644.416,61	2,19
HKD CHINA VANKE -H-	191.000,00	455.364,22	1,55
BRL CIELO	64.000,00	564.134,77	1,92
TRY COCA-COLA ICECEK SANAYI	13.000,00	158.554,15	0,54
EUR DO & CO	2.900,00	300.114,39	1,02
TWD ECLAT TEXTILE	42.000,00	450.747,61	1,53
TRY EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	602.000,00	550.670,75	1,88
CLP FALABELLA SOCIEDAD ANONIMA COMERCIAL E INDUSTRIAL	52.000,00	367.277,57	1,25
MXN GRUMA SA De CV GRUMA	42.000,00	605.518,28	2,06
KRW HOTEL SHILLA	11.900,00	658.004,67	2,24
BRL ITAU UNIBANCO HOLDING (pref. shares)	64.000,00	516.161,10	1,76
USD JD.COM ADR	20.300,00	499.583,00	1,70
EUR JERONIMO MARTINS	38.000,00	615.938,96	2,10
CNH KWEICHOW MOUTAI -A-	100,00	4.015,92	0,01
TWD LARGAN PRECISION	5.500,00	458.720,01	1,56
USD LENTA (reg. shares) GDR	99.394,00	679.854,96	2,32
KRW LG HOUSEHOLD & HEALTHCARE	1.415,00	1.253.767,36	4,27
BRL LOJAS RENNER	100.500,00	583.138,22	1,99
USD MAGNIT	3.000,00	424.055,17	1,44
PHP MEGAWORLD CORPORATION	4.750.000,00	457.072,48	1,56
IDR MITRA ADIPERKASA	845.700,00	234.022,39	0,80
ZAR MR. PRICE GROUP	48.500,00	568.937,43	1,94
BRL MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS	34.000,00	515.855,71	1,76
ZAR NASPERS -N-	6.350,00	933.269,72	3,18
GBP NMC HEALTH	40.000,00	669.536,44	2,28
HKD PAX GLOBAL TECHNOLOGY	429.000,00	361.728,85	1,23
HKD PING AN INSURANCE COMPANY OF CHINA -H-	118.000,00	527.103,67	1,80
IDR PT SUMMARECON AGUNG TBK	4.330.000,00	507.174,21	1,73
KRW SAMSUNG ELECTRONICS	500,00	542.037,23	1,85
HKD SANDS CHINA	84.000,00	322.240,49	1,10
HKD SHIMAO PROPERTY HOLDINGS	349.000,00	442.084,29	1,51
KRW SK TELECOM	1.800,00	335.291,14	1,14
USD TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING ADR	24.800,00	613.056,00	2,09
USD TATA MOTORS ADR	19.500,00	653.055,00	2,22
HKD TENCENT HOLDINGS	53.500,00	1.193.539,79	4,06
TRY ULKER BISKUVI SANAYI	51.500,00	372.334,60	1,27
PHP UNIVERSAL ROBINA	68.000,00	283.545,31	0,97
MXN WAL-MART DE MEXICO SAB	246.000,00	572.654,33	1,95
ZAR WOOLWORTHS HOLDINGS	90.000,00	476.093,48	1,62
USD X 5 RETAIL GROUP	47.052,00	919.866,60	3,13
Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)		27.127.126,34	92,38
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere: Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)			
		27.127.126,34	92,38
Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere: Investmentfonds			
Fondsanteile (Open-End)			
USD DB X-TRACKERS S&P CNX NIFTY -1C-	4.470,00	554.301,98	1,89
USD EGA EMERGING GLOBAL SHARE TRUST INDIA CONSUMER ETF	19.700,00	634.852,20	2,16
USD ISHARES INDIA 50 ETF	11.300,00	315.157,00	1,07
USD LYXOR INTERNATIONAL ASSET MANAGEMENT - LYXOR ETF MSCI INDIA -B-	33.700,00	507.522,00	1,73
Fondsanteile (Open-End)		2.011.833,18	6,85
Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere: Investmentfonds			
		2.011.833,18	6,85
Total des Wertpapierbestandes		29.138.959,52	99,23
Bankguthaben und sonstige		946.638,99	3,22
Bankverbindlichkeiten und sonstige		-426.039,11	-1,45
Andere Passiva		-294.606,65	-1,00
Fondsvermögen		29.364.952,75	100,00

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.
Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Technische Daten und Erläuterungen**Technische Daten**

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A -Ausschüttend	USD	25142035	LU1097743329	1,10%	1,38%
B -Thesaurierend	USD	25142036	LU1097743592	1,10%	1,38%
UA -Ausschüttend	USD	26358924	LU1144419535	0,90%	1,19%
UB -Thesaurierend	USD	27227823	LU1195447187	0,90%	1,20%
AH -Ausschüttend	CHF	25407883	LU1109643400	1,10%	1,38%
BH -Thesaurierend	CHF	25508532	LU1114186320	1,10%	1,37%
UAH -Ausschüttend	CHF	26362606	LU1144419618	0,90%	1,19%
UBH -Thesaurierend	CHF	27227824	LU1195451379	0,90%	1,20%
AH -Ausschüttend	EUR	25407890	LU1109644804	1,10%	1,38%
BH -Thesaurierend	EUR	25508534	LU1114186759	1,10%	1,37%
UAH -Ausschüttend	EUR	26362608	LU1144419709	0,90%	1,19%
UBH -Thesaurierend	EUR	26362609	LU1144419881	0,90%	1,19%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2015
A -Ausschüttend	USD	4,85%	-4,26%	-7,56%
B -Thesaurierend	USD	4,85%	-2,96%	-7,56%
UA -Ausschüttend	USD	4,94%	-3,11%	/
UB -Thesaurierend	USD	4,93%	-3,51%	/
AH -Ausschüttend	CHF	4,14%	-7,03%	-8,56%
BH -Thesaurierend	CHF	4,12%	-4,87%	-8,66%
UAH -Ausschüttend	CHF	4,26%	-4,89%	/
UBH -Thesaurierend	CHF	4,16%	-5,25%	/
AH -Ausschüttend	EUR	4,40%	-5,05%	-8,05%
BH -Thesaurierend	EUR	4,36%	-4,63%	-7,85%
UAH -Ausschüttend	EUR	3,30%	-4,91%	/
UBH -Thesaurierend	EUR	4,45%	-3,90%	/

Technische Daten und Erläuterungen**Ausschüttungen**

		Ex-Datum	Betrag
A-Ausschüttend	USD	16.12.2015	1,85
A-Ausschüttend	USD	16.03.2016	1,65
UA-Ausschüttend	USD	16.12.2015	1,88
UA-Ausschüttend	USD	16.03.2016	1,70
AH-Ausschüttend	CHF	16.12.2015	1,85
AH-Ausschüttend	CHF	16.03.2016	1,60
UAH-Ausschüttend	CHF	16.12.2015	1,88
UAH-Ausschüttend	CHF	16.03.2016	1,65
AH-Ausschüttend	EUR	16.12.2015	1,88
AH-Ausschüttend	EUR	16.03.2016	1,60
UAH-Ausschüttend	EUR	16.12.2015	1,88
UAH-Ausschüttend	EUR	16.03.2016	1,70

Erläuterungen**Finanzterminkontrakte**

Beschreibung	Währung	Anzahl	Liquidationsbetrag	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>				(in USD)
MSCI EUROPE 06/16	EUR	-100,00	-1.855.000,00	3.339,75
S&P E-MINI 500 STOCK INDEX -50- 06/16	USD	-20,00	-2.094.900,00	-9.400,00
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Finanzterminkontrakten				-6.060,25

Gegenpartei: Credit Suisse Zürich

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in USD)
CHF	28.914.671,60	USD	-29.451.646,68	15.06.2016	-350.995,90
Credit Suisse Zürich					
EUR	10.287.696,22	USD	-11.470.740,12	15.06.2016	-13.456,30
Credit Suisse Zürich					
USD	408.192,84	CHF	-400.000,00	23.09.2016	3.818,84
Credit Suisse Zürich					
USD	1.165.666,95	AUD	-1.575.000,00	23.09.2016	30.030,97
Credit Suisse Zürich					
USD	228.926,87	TRY	-700.000,00	23.09.2016	-1.340,91
Credit Suisse Zürich					
USD	14.565.901,05	EUR	-13.050.000,00	23.09.2016	-11.328,06
Credit Suisse Zürich					
USD	568.762,23	CAD	-760.000,00	23.09.2016	-11.988,25
Credit Suisse Zürich					
USD	4.310.147,15	GBP	-3.050.000,00	23.09.2016	-131.103,39
Credit Suisse Zürich					
USD	134.803,17	ZAR	-2.250.000,00	23.09.2016	-5.183,49
Credit Suisse Zürich					
USD	1.150.927,49	JPY	-130.000.000,00	23.09.2016	-24.669,95
Credit Suisse Zürich					
USD	519.655,61	SGD	-720.000,00	23.09.2016	-2.904,06
Credit Suisse Zürich					

Technische Daten und Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in USD)
USD	696.272,43	HKD	-5.400.000,00	23.09.2016	703,70
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	131.953,17	EUR	-117.229,60	15.06.2016	1.395,43
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	99.999,88	USD	-112.121,47	15.06.2016	-752,80
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	28.557,69	CHF	-27.317,15	15.06.2016	1.064,23
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	27.898,00	USD	-29.161,39	15.06.2016	-1.083,95
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	56.128,00	USD	-64.054,23	15.06.2016	-1.545,15
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	89.999,94	USD	-102.403,55	15.06.2016	-2.171,70
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	216.437,25	CHF	-206.704,70	15.06.2016	8.398,20
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	196.713,74	CHF	-187.168,40	15.06.2016	8.336,66
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	489.477,55	USD	-510.117,40	15.06.2016	-17.491,53
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	24.620,15	USD	-25.584,23	15.06.2016	-805,73
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	44.307,71	USD	-50.018,97	15.06.2016	-674,01
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	204.620,20	USD	-212.943,01	15.06.2016	-7.006,69
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	1.088.635,70	CHF	-1.045.236,15	15.06.2016	36.655,66
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	201.046,65	USD	-229.236,41	15.06.2016	-5.333,17
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	1.467.928,95	USD	-1.528.763,73	15.06.2016	-51.393,06
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	6.740,85	USD	-7.629,39	15.06.2016	-122,19
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	40.800,00	USD	-45.981,19	15.06.2016	-542,72
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	115.471,00	EUR	-100.000,00	23.09.2016	3.755,05
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	276.455,20	CHF	-267.526,80	15.06.2016	7.203,62
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	330.000,00	USD	-377.651,01	23.09.2016	-9.030,45
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	35.641,65	EUR	-31.467,99	15.06.2016	595,89
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	85.672,07	USD	-96.023,14	15.06.2016	-611,18
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	442.382,29	USD	-493.867,18	15.06.2016	-1.191,34
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	83.844,91	CHF	-83.020,80	15.06.2016	290,03
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	100.279,76	AUD	-140.000,00	23.09.2016	-681,02
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	403.128,00	USD	-449.139,42	15.06.2016	-180,60
<i>Credit Suisse Zürich</i>					

Technische Daten und Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in USD)
CHF	249.824,00	USD	-251.786,17	15.06.2016	-355,30
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
EUR	49.578,48	USD	-55.339,35	15.06.2016	-124,39
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	131.886,73	CHF	-130.580,00	15.06.2016	466,69
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-551.352,32

Nettovermögensaufstellung in USD und Fondsentwicklung

	31.05.2016
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	94.374.200,70
Bankguthaben und sonstige	707.992,37
Forderungen aus Zeichnungen	1.113.148,62
Forderungen aus Erträgen	868.899,57
Andere Aktiva	337,20
	97.064.578,46
Passiva	
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	233.294,54
Rückstellungen für Aufwendungen	102.673,90
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Finanzterminkontrakten	6.060,25
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	551.352,32
	893.381,01
Nettovermögen	96.171.197,45

Nettovermögensaufstellung in USD und Fondsentwicklung

Fondsentwicklung		31.05.2016	30.11.2015	30.11.2014
Fondsvermögen	USD	96.171.197,45	93.637.246,02	20.705.065,06
Nettoinventarwert pro Aktie				
A - Ausschüttend	USD	133,04	132,96	150,47
B - Thesaurierend	USD	145,56	141,58	/
UA - Ausschüttend	USD	137,19	136,94	/
UB - Thesaurierend	USD	144,74	140,64	/
AH - Ausschüttend	CHF	130,47	131,45	150,39
BH - Thesaurierend	CHF	142,69	140,05	/
UAH - Ausschüttend	CHF	134,64	135,44	/
UBH - Thesaurierend	CHF	142,13	139,39	/
AH - Ausschüttend	EUR	131,61	132,20	150,39
BH - Thesaurierend	EUR	143,05	139,95	151,09
UAH - Ausschüttend	EUR	136,19	136,62	/
UBH - Thesaurierend	EUR	144,15	140,88	/

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Periode	zu Beginn der Periode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
A - Ausschüttend	USD	275.456,442	291.980,406	24.313,207	40.837,171
B - Thesaurierend	USD	43.941,265	48.712,036	4.601,742	9.372,513
UA - Ausschüttend	USD	62.991,508	52.735,616	14.084,734	3.828,842
UB - Thesaurierend	USD	8.775,132	4.986,990	3.788,142	0,000
AH - Ausschüttend	CHF	60.838,722	103.182,387	1.808,834	44.152,499
BH - Thesaurierend	CHF	2.247,839	3.327,726	44,274	1.124,161
UAH - Ausschüttend	CHF	154.748,915	116.166,181	39.947,123	1.364,389
UBH - Thesaurierend	CHF	5.192,901	1.775,901	3.417,000	0,000
AH - Ausschüttend	EUR	69.873,994	61.187,818	12.625,334	3.939,158
BH - Thesaurierend	EUR	14.547,006	13.670,863	1.096,940	220,797
UAH - Ausschüttend	EUR	2.671,381	1.270,585	1.400,796	0,000
UBH - Thesaurierend	EUR	365,900	365,900	0,000	0,000

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens in USD

Für die Periode vom
01.12.2015 bis zum
31.05.2016

Nettovermögen zu Beginn der Periode	93.637.246,02
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	1.282.928,01
Dividenden (Netto)	1.436.339,44
Bankzinsen	1.002,04
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	19.543,58
Andere Erträge	5,76
	2.739.818,83
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	450.033,79
Depotbank- und Depotgebühr	20.653,10
Verwaltungskosten	27.535,41
Druck- und Veröffentlichungskosten	10.297,30
Zinsen und Bankspesen	35,63
Kosten für Revision, Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	22.541,98
"Taxe d'abonnement"	22.973,62
	554.070,83
Nettoerträge (-verluste)	2.185.748,00
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-553.434,47
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	16.456,38
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-1.090.949,18
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	752.013,36
	-875.913,91
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	1.309.834,09
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	1.596.550,83
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Finanzterminkontrakten	37.182,67
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	980.067,98
	2.613.801,48
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	3.923.635,57
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	14.375.951,34
Rücknahmen	-13.567.957,10
	807.994,24
Ausschüttung	-2.197.678,38
Nettovermögen am Ende der Periode	96.171.197,45

Geographische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestandes
Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte
Geographische Aufteilung

USA	23,99
Luxemburg	11,66
Irland	6,82
Vereinigtes Königreich	6,39
Frankreich	4,41
Niederlande	4,25
Cayman-Inseln	2,45
Japan	2,30
Italien	2,28
Hongkong	2,06
Deutschland	2,01
Australien	1,81
Türkei	1,48
Peru	1,29
Brasilien	1,22
Mexiko	1,14
Vereinigte Arabische Emirate	1,10
Kanada	1,06
Kolumbien	0,99
Indien	0,90
Chile	0,88
Singapur	0,88
Taiwan	0,84
Spanien	0,83
Bermudas	0,76
Portugal	0,69
Kroatien	0,67
Britische Jungferninseln	0,64
Finnland	0,63
Costa Rica	0,59
Indonesien	0,59
Belgien	0,58
Südafrika	0,55
Norwegen	0,54
Jersey	0,51
Ungarn	0,48
Tschechische Republik	0,41
Internationale Organisationen	0,41
Argentinien	0,41
Sri Lanka	0,40
Thailand	0,38
Schweiz	0,38
Philippinen	0,34
Volksrepublik China	0,34
Schweden	0,30
Malaysia	0,27
Litauen	0,25
Rumänien	0,25
Slovenien	0,24
Polen	0,24
Südkorea	0,24
Panama	0,23
Kasachstan	0,22
Namibia	0,22
Neuseeland	0,22
Togo	0,21

Marokko	0,21
Bahrain	0,21
Paraguay	0,21
Ägypten	0,21
Tunesien	0,19
Österreich	0,13
Albanien	0,12
Montenegro	0,12
Isle of Man	0,11
Dänemark	0,11
Griechenland	0,10
El Salvador	0,10
Libanon	0,05
Gabon	0,03
Total	98,13

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	19,13
Holding- und Finanzgesellschaften	10,45
Banken und andere Kreditinstitute	10,41
Länder und Zentralregierungen	6,45
Telekommunikation	6,08
Energie- und Wasserversorgung	5,15
Versicherungsgesellschaften	4,38
Erdöl	3,83
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	2,60
Elektrische Geräte und Komponenten	2,43
Immobilien	2,20
Computer und Netzwerkausrüster	1,92
Baugewerbe und -material	1,76
Verkehr und Transport	1,62
Tabak und alkoholische Getränke	1,53
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	1,51
Fahrzeuge	1,42
Bergbau, Kohle und Stahl	1,39
Nahrungsmittel und Softdrinks	1,24
Nichteisenmetalle	1,17
Diverse Dienstleistungen	1,09
Elektronik und Halbleiter	1,03
Graphisches Gewerbe, Verlage und Medien	0,89
Chemie	0,89
Maschinen und Apparate	0,67
Supranationale Organisationen	0,62
Gastgewerbe und Freizeiteinrichtungen	0,60
Flugzeug- und Raumfahrtindustrie	0,59
Diverse Konsumgüter	0,56
Diverse Handelsfirmen	0,51
Landwirtschaft und Fischerei	0,51
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	0,49
Einzelhandel und Warenhäuser	0,41
Forstwirtschaft, Holz und Papier	0,38
Pfandbr.-Institute und Refinanz.-Ges. (MBA, ABS)	0,38
Kantone, Bundesstaaten, Provinzen	0,28
Städte, Gemeinden	0,26
Gummi und Reifen	0,25
Gesundheits- und Sozialwesen	0,24

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.
Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte (Fortsetzung)

Biotechnologie	0,23	Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte			
Verpackungsindustrie	0,22				
Umwelt und Recycling	0,13	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermögens
Photo und Optik	0,12	Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Index	0,09	Anleihen			
Edelmetalle und -steine	0,02	USD BANCO CREDIT PERU FIX-TO-FRN 6.125%/09-24.04.2027	200.000,00	215.702,00	0,23
Total	98,13	Anleihen		215.702,00	0,23
Verkaufsoptionen (put)					
GBP FTSE 100 INDEX (put) -6025- 16.09.2016			21,00	53.642,97	0,05
USD S&P 500 INDEX (put) -1975- 16.09.2016			10,00	33.880,00	0,04
				87.522,97	0,09
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere				303.224,97	0,32
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere: Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)					
Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)					
USD ABBOTT LABORATORIES			3.500,00	138.705,00	0,14
USD ABBVIE			2.000,00	125.860,00	0,13
GBP ABERDEEN ASSET MANAGEMENT			25.000,00	101.558,49	0,11
USD ACCENTURE -A-			2.000,00	237.940,00	0,26
GBP ADMIRAL GROUP			4.500,00	128.900,32	0,13
THB ADVANCED INFO SERVICE PUBLIC (nv)			7.000,00	32.330,31	0,03
EUR AGEAS			2.500,00	101.180,51	0,11
USD ALLETE			1.500,00	86.610,00	0,09
EUR ALLIANZ SE (reg. shares) (restricted)			750,00	122.485,33	0,13
USD ALTRIA GROUP			3.000,00	190.920,00	0,20
GBP AMEC			8.000,00	50.861,48	0,05
USD AMEREN			4.000,00	198.200,00	0,21
JPY AOZORA BANK			25.000,00	84.982,64	0,09
USD APPLE			1.750,00	174.755,00	0,18
USD APPLE HOSPITALITY REIT			2.500,00	45.575,00	0,05
SGD ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST			50.000,00	83.165,63	0,09
SGD ASCOTT RESIDENCE TRUST - UNITS REIT			60.000,00	49.899,38	0,05
USD ASHFORD HOSPITALITY TRUST			4.000,00	20.120,00	0,02
GBP ASHMORE GROUP			15.000,00	63.467,69	0,07
TWD ASIA CEMENT			45.000,00	34.289,01	0,04
GBP ASTRAZENECA			2.250,00	131.913,23	0,14
TWD ASUSTEK COMPUTER			4.500,00	38.635,51	0,04
EUR ATOS			1.700,00	157.193,13	0,16
USD AT&T			5.000,00	195.750,00	0,20
AUD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP			3.000,00	55.376,71	0,06
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING			2.000,00	175.680,00	0,18
GBP AVIVA			12.000,00	78.562,82	0,08
EUR AXEL SPRINGER (reg. shares)			1.500,00	85.364,01	0,09
GBP BAE SYSTEMS			20.000,00	140.777,31	0,15
BRL BANCO BRADESCO (pref. shares)			4.000,00	25.319,43	0,03
BRL BANCO DO BRASIL			5.000,00	22.862,45	0,02
BRL BANCO SANTANDER BRASIL (units)			6.000,00	28.950,77	0,03
EUR BANCO SANTANDER (reg. shares)			12.500,00	59.711,95	0,06
CHF BANQUE CANTONALE VAUDOISE			100,00	69.200,97	0,07
EUR BASF (reg. shares)			500,00	38.646,47	0,04
BRL BB SEGURIDADE PARTICIPACOES			3.000,00	22.704,20	0,02
THB BEC WORLD PUBLIC (nvdr)			40.000,00	27.655,71	0,03
GBP BHP BILLITON			8.000,00	95.831,04	0,10
EUR BMW			1.300,00	109.829,91	0,11
HKD BOC HONG KONG			11.000,00	33.843,49	0,04
EUR BOUYGUES			1.400,00	45.509,66	0,05
EUR BPOST			3.500,00	92.305,12	0,10
BRL BRADESPAR (pref. shares)			20.000,00	38.700,98	0,04
BRL BRASKEM (pref. shares)			4.000,00	23.320,53	0,02
JPY BRIDGESTONE			1.500,00	51.746,99	0,05
USD BRISTOL MYERS SQUIBB			2.000,00	143.400,00	0,15
GBP BRITISH AMERICAN TOBACCO			1.500,00	91.653,72	0,10
THB BTS GROUP HOLDINGS PUBLIC COMPANY			150.000,00	38.208,54	0,04
SGD CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST			115.000,00	44.687,91	0,05
CAD CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE			1.000,00	77.784,16	0,08
JPY CANON			4.500,00	130.327,75	0,14
EUR CAP GEMINI			1.000,00	95.405,53	0,10
SGD CAPTAMALL TRUST			50.000,00	73.723,24	0,08
USD CARADOR INCOME FUND			1.200.000,00	828.000,00	0,87
GBP CARILLION			22.000,00	88.795,09	0,09
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON			1.500,00	89.288,22	0,09
USD CATERPILLAR			2.000,00	145.020,00	0,15
USD CBL & ASSOCIATES PROPERTIES			2.000,00	19.240,00	0,02
CHF CEMBRA MONEY (reg. shares)			1.400,00	94.346,67	0,10
USD CENTERPOINT ENERGY			3.500,00	78.855,00	0,08
GBP CENTRICA			25.000,00	74.158,44	0,08
USD CENTURYLINK			5.000,00	135.600,00	0,14
CZK CESKE ENERGETICKE ZAVODY			7.500,00	136.285,43	0,14
USD CHEVRON			2.000,00	202.000,00	0,21
TWD CHICONY ELECTRONICS			18.000,00	43.382,16	0,05
HKD CHINA CONSTRUCTION BANK -H-			65.000,00	41.921,39	0,04
HKD CHINA HONGQIAO GROUP			75.000,00	53.777,55	0,06
BRL CIA DE CONCESSOES RODOVIARIAS			6.000,00	25.402,72	0,03
BRL CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS (pref. shares)			15.000,00	23.445,46	0,02

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Netto- vermögens	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Netto- vermögens
USD CINCINNATI FINANCIAL	3.000,00	207.300,00	0,22	HKD INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA -H-	75.000,00	39.778,01	0,04
USD CME GROUP -A-	1.500,00	146.835,00	0,15	CHF INFICON HOLDING (reg. shares)	100,00	33.418,64	0,03
USD COACH	4.500,00	177.390,00	0,18	AUD INSURANCE AUSTRALIA GROUP	20.000,00	85.194,93	0,09
AUD COCA-COLA AMATIL	10.000,00	64.330,87	0,07	USD INTEL	5.500,00	173.745,00	0,18
EUR COFINIMMO SICAFI	800,00	97.520,70	0,10	CAD INTER PIPELINE	4.000,00	81.491,81	0,08
SGD COMFORTDELGRO CORPORATION	15.000,00	29.852,47	0,03	EUR INTESA SANPAOLO	25.000,00	64.234,53	0,07
USD COMMUNICATIONS SALES & LEASING	2.000,00	49.960,00	0,05	THB INTOUCH HOLDINGS PUBLIC (nvdr)	20.000,00	31.350,60	0,03
USD CONOCOPHILLIPS	3.500,00	153.265,00	0,16	TWD INVENTEC	80.000,00	53.231,15	0,06
NZD CONTACT ENERGY	25.000,00	91.164,60	0,09	BRL INVESTIMENTOS ITAU (pref. shares)	15.000,00	29.733,68	0,03
USD CORNING	7.000,00	146.230,00	0,15	JPY ITOCHU	7.500,00	94.100,80	0,10
HKD COSCO PACIFIC	30.000,00	30.354,87	0,03	GBP J. SAINSBURY	15.000,00	58.620,83	0,06
USD COSTCO WHOLESALE	300,00	44.631,00	0,05	JPY JAPAN TOBACCO	2.100,00	83.352,41	0,09
EUR CREDIT AGRICOLE	6.000,00	60.282,49	0,06	BRL JBS	10.000,00	27.762,54	0,03
CAD CRESCENT POINT ENERGY CORP	3.500,00	59.398,82	0,06	HKD JIANGSU EXPRESSWAY S. -H-	74.000,00	101.357,97	0,11
EUR CTT-CORREIOS DE PORTUGAL	10.000,00	89.984,00	0,09	USD JOHNSON & JOHNSON	1.500,00	169.035,00	0,18
AUD CYBG	750,00	3.156,78	0,00	SGD KEPPEL	12.500,00	48.846,19	0,05
USD CYPRESS SEMICONDUCTOR	20.000,00	212.600,00	0,22	THB KIATNAKIN BANK PUBLIC COMPANY (nvdr)	45.000,00	52.274,33	0,05
EUR DAIMLER (reg. shares)	1.000,00	68.342,42	0,07	MXN KIMBERLY CLARK DE MEXICO -A-	30.000,00	71.466,05	0,07
JPY DAITO TRUST CONSTRUCTION	600,00	87.074,52	0,09	EUR KLEPIERRE	1.500,00	68.648,56	0,07
THB DELTA ELECTRONIC NVDR	15.000,00	30.125,97	0,03	CZK KOMERCNI BANKA	3.750,00	147.531,84	0,15
EUR DELTA LLOYD	5.000,00	25.192,85	0,03	EUR KONINKLIJKE AHOLD	3.000,00	66.494,42	0,07
EUR DEUTSCHE POST (reg. shares)	2.500,00	72.959,62	0,08	EUR KONINKLIJKE DSM	750,00	44.660,81	0,05
AUD DEXUS PROPERTY GROUP (stapled security)	15.000,00	94.105,63	0,10	TRY KOZA ALTIN IZLETMELERI	5.000,00	23.274,94	0,02
USD DOW CHEMICAL	3.000,00	154.080,00	0,16	BRL KROTON EDUCACIONAL (conv. shares)	7.000,00	21.532,62	0,02
AUD DOWNER EDI	18.000,00	50.986,56	0,05	ZAR KUMBA IRON ORE	1.500,00	7.724,12	0,01
USD DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	2.500,00	163.525,00	0,17	EUR LAGARDERE (reg. shares)	4.500,00	106.579,77	0,11
USD DUKE ENERGY	2.500,00	196.575,00	0,20	USD LAS VEGAS SANDS	3.500,00	161.840,00	0,17
BRL ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA E LOGISTICA	15.000,00	32.690,39	0,03	GBP LEGAL & GENERAL GROUP	25.000,00	87.112,51	0,09
EUR EDENRED	4.500,00	83.410,26	0,09	USD LEXINGTON REALITY TRUST	3.500,00	33.075,00	0,03
EUR EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL (reg. shares)	25.000,00	83.354,59	0,09	HKD LI & FUNG	54.000,00	27.527,93	0,03
GBP ELECTROCOMPONENTS	15.000,00	61.961,23	0,06	USD LIBERTY PROPERTY TRUST	2.000,00	74.640,00	0,08
USD ELI LILLY & CO	2.000,00	150.060,00	0,16	ZAR LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS	7.500,00	18.311,29	0,02
EUR ELISA -A-	2.000,00	76.235,36	0,08	TWD LITE-ON TECHNOLOGY	40.200,00	51.771,58	0,05
BRL EMBRAER	5.000,00	26.096,79	0,03	USD LOCKHEED MARTIN	750,00	177.172,50	0,18
USD EMERSON ELECTRIC	1.500,00	78.030,00	0,08	AUD MACQUARIE GROUP	1.750,00	94.918,82	0,10
EUR ENAGAS	4.000,00	119.963,82	0,12	EUR MAPFRE (reg. shares)	45.000,00	114.119,26	0,12
EUR ENGIE	5.000,00	77.064,73	0,08	SGD MAPLETREE LOGISTICS TRUST	60.000,00	42.490,74	0,04
EUR ENI	3.000,00	45.854,77	0,05	NOK MARINE HARVEST	10.000,00	167.042,80	0,17
USD ENSCO -A-	4.000,00	39.560,00	0,04	GBP MARKS & SPENCER	4.720,00	26.085,49	0,03
USD ENTERGY	2.500,00	189.800,00	0,20	USD MATTEL	9.000,00	286.920,00	0,31
TRY EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TURK ANONIM SIRKETI	40.000,00	55.832,74	0,06	USD MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5.000,00	189.800,00	0,20
BRL ESTACIO PARTICIPACOES	7.000,00	21.105,08	0,02	USD MEDICAL PROPERTIES TRUST	2.500,00	36.750,00	0,04
USD EXXON MOBIL	2.000,00	178.040,00	0,19	USD MEDTRONIC	2.000,00	160.960,00	0,17
USD FORD MOTOR	12.000,00	161.880,00	0,17	EUR MERCK & CO	3.000,00	168.780,00	0,18
EUR FORTUM	5.000,00	75.033,05	0,08	EUR METKA (reg. shares)	8.500,00	74.754,74	0,08
USD FRANKLIN STREET PROPERTIES	2.500,00	28.525,00	0,03	USD MICROCHIP TECHNOLOGY	3.500,00	180.880,00	0,19
SGD FRASERS CENTREPOINT TRUST	45.000,00	66.024,07	0,07	USD MICROSOFT	4.000,00	212.000,00	0,22
EUR FRENET (reg. shares)	3.000,00	82.742,31	0,09	AUD MINERAL RESOURCES	15.000,00	89.324,28	0,09
USD FRONTIER COMMUNICATIONS	25.000,00	129.250,00	0,13	JPY MIRVAC GROUP	50.000,00	70.452,44	0,07
GBP GALLIFORD TRY	2.000,00	40.375,96	0,04	JPY MITSUI & CO	7.500,00	90.279,96	0,09
EUR GALP ENERGIA -B-	10.000,00	131.140,85	0,14	GBP MORRISON (W.M.) SUPERMARKETS	37.500,00	108.181,08	0,11
USD GAMING AND LEISURE PROPERTIES	1.000,00	32.910,00	0,03	EUR MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT (reg. shares) (restricted)	700,00	131.580,58	0,14
USD GARMIN (reg. shares)	4.500,00	191.340,00	0,20	EUR M6 METROPOLE TELEVISION	3.500,00	64.270,71	0,07
EUR GAZTRANSPORT ET TECHNIGAZ	2.000,00	67.874,85	0,07	AUD NATIONAL AUSTRALIA BANK	3.000,00	59.006,18	0,06
EUR GECINA	500,00	70.663,54	0,07	USD NATIONAL CINEMEDIA	11.000,00	160.600,00	0,17
USD GENERAL ELECTRIC	6.000,00	181.380,00	0,19	GBP NATIONAL GRID	4.000,00	58.628,10	0,06
AUD GENWORTH MORTGAGE INSURANCE AUSTRALIA	40.000,00	77.660,69	0,08	EUR NATIXIS	15.000,00	72.439,18	0,08
CAD GIBSON ENERGY	5.000,00	58.710,80	0,06	BRL NATURA COSMETICOS	6.000,00	37.512,74	0,04
GBP GLAXOSMITHKLINE	7.500,00	157.741,33	0,16	EUR NEOPOST	2.500,00	60.393,81	0,06
GBP GLENCORE	30.000,00	57.245,37	0,06	USD NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	4.500,00	46.665,00	0,05
THB GLOW ENERGY PUBLIC COMPANY (nvdr)	20.000,00	48.145,56	0,05	USD NEW YORK COMMUNITY BANCORP	13.000,00	204.620,00	0,21
USD GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	3.000,00	58.800,00	0,06	JPY NISSAN MOTOR	7.000,00	71.006,71	0,07
AUD GPT GROUP (stapled security)	25.000,00	97.438,08	0,10	USD NOBLE	7.500,00	62.550,00	0,07
USD GRAMERCY STREET PROPERTIES	4.000,00	35.720,00	0,04	SGD NOBLE GROUP	150.000,00	32.140,43	0,03
CAD GREAT WEST LIFE CO	2.500,00	67.540,35	0,07	EUR NOKIA	15.000,00	85.831,58	0,09
EUR GREEK ORGANISATION OF FOOTBALL PROGNOSTICS	2.500,00	20.483,80	0,02	EUR NOKIAN TYRES	2.500,00	88.308,56	0,09
USD HARRIS	2.000,00	157.540,00	0,16	CHF NOVARTIS (reg. shares)	600,00	47.615,90	0,05
AUD HARVEY NORMAN HOLDINGS	10.000,00	33.034,77	0,03	TWD NOVATEK MICROELECTRONICS	13.000,00	43.250,31	0,04
USD HCP	1.500,00	49.305,00	0,05	JPY NTT DOCOMO	3.500,00	87.701,18	0,09
BRL HELBOR EMPREENDIMENTOS	50.000,00	18.739,71	0,02	USD OCCIDENTAL PETROLEUM	500,00	37.720,00	0,04
HKD HKT (stapled security)	20.000,00	28.990,32	0,03	BRL ODONTOPREV	10.000,00	31.121,80	0,03
JPY HOKURIKU ELECTRIC POWER	5.000,00	62.440,82	0,06	EUR OMV	2.500,00	69.717,28	0,07
USD HOLLYFRONTIER	2.500,00	66.900,00	0,07	USD ONEOK (new)	3.500,00	151.375,00	0,16
USD HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	1.000,00	25.600,00	0,03	AUD ORICA	8.500,00	83.746,04	0,09
USD HOST HOTELS AND RESORTS	5.000,00	77.000,00	0,08	NOK ORKLA	10.000,00	90.516,39	0,09
CAD H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5.000,00	81.109,58	0,08	SGD QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	60.000,00	28.980,86	0,03
GBP HSBC HOLDINGS	15.000,00	97.166,48	0,10	CZK O2 CZECH REPUBLIC AS	12.000,00	116.171,67	0,12
HKD HUABAO INTERNATIONAL HOLDINGS	50.000,00	19.374,08	0,02	USD PAYCHEX	3.500,00	189.770,00	0,20
EUR HUGO BOSS (reg. shares)	1.000,00	61.484,80	0,06	HKD PEAK SPORT PRODUCTS	175.000,00	50.012,16	0,05
USD HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	140.000,00	60.200,00	0,06	GBP PEARSON	5.000,00	61.022,42	0,06
EUR IBERDROLA	10.000,00	67.863,72	0,07	TWD PEGATRON	18.000,00	37.476,44	0,04
USD IBM	1.000,00	153.740,00	0,16	CAD PEMBINA PIPELINE	3.000,00	88.226,73	0,09
GBP ICAP	10.000,00	62.878,20	0,07	USD PEOPLES UNITED FINANCIAL	12.000,00	190.560,00	0,20
GBP IMPERIAL BRANDS	2.000,00	109.483,76	0,11	GBP PERSIMMON	1.455,00	44.515,59	0,05
				GBP PETROFAC	3.000,00	33.971,70	0,04

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Netto- vermögens	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Netto- vermögens
USD PFIZER	5.500,00	190.850,00	0,20	JPY TREND MICRO	2.000,00	72.494,47	0,08
USD PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2.000,00	197.360,00	0,21	DKK TRYG A/S	3.000,00	59.176,18	0,06
TWD PHISON ELECTRONICS	6.000,00	49.306,27	0,05	TRY TURK TELEKOMUNIKASYON	20.000,00	40.858,18	0,04
USD PINNACLE WEST CAPITAL	1.000,00	73.590,00	0,08	EUR UNIBAIL RODAMCO	600,00	161.577,11	0,17
BRL PORTO SEGURO	4.000,00	29.317,24	0,03	EUR UNILEVER (cert. shares)	3.000,00	134.809,01	0,14
CAD POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	4.500,00	73.617,84	0,08	EUR UNIONE DI BANCHE ITALIANE	15.000,00	55.773,83	0,06
CAD POWER FINANCIAL	1.400,00	33.969,70	0,04	EUR UNIPOLSAI	40.000,00	80.020,41	0,08
TWD POWERTECH TECHNOLOGY	25.000,00	53.890,40	0,06	USD UNITED PARCEL SERVICE -B-	500,00	51.545,00	0,05
USD PPL	4.000,00	154.160,00	0,16	EUR UPM-KYMMENE	2.575,00	49.563,84	0,05
EUR PROSIEBEN SAT.1 MEDIA	2.000,00	100.604,40	0,10	USD VALE ADR	15.000,00	58.950,00	0,06
EUR PROXIMUS	1.450,00	47.135,01	0,05	USD VERIZON COMMUNICATIONS	4.500,00	229.050,00	0,24
THB PTT GLOBAL CHEMICAL PUBLIC (nvdr)	25.000,00	41.637,52	0,04	GBP VODAFONE GROUP	20.000,00	67.201,08	0,07
USD PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	4.000,00	179.000,00	0,19	USD WASTE MANAGEMENT	2.000,00	121.900,00	0,13
BRL QUALICORP	8.000,00	33.870,30	0,04	USD WELLTOWER	1.000,00	68.910,00	0,07
TWD RADIANT OPTO-ELECTRONICS	16.000,00	24.677,66	0,03	AUD WESFARMERS	3.000,00	88.302,81	0,09
EUR RANDSTAD HOLDING	2.000,00	108.085,44	0,11	USD WESTERN UNION	8.000,00	155.600,00	0,16
USD RAYONIER	5.000,00	129.650,00	0,13	AUD WESTPAC BANKING	3.000,00	66.721,54	0,07
TWD REALTEK SEMICONDUCTOR	22.000,00	59.633,60	0,06	USD WILLIAMS COMPANIES	2.750,00	60.940,00	0,06
EUR RED ELECTRICA DE ESPANA	1.000,00	89.104,53	0,09	USD WINDSTREAM HOLDINGS	22.000,00	184.580,00	0,19
EUR REPSOL	9.000,00	115.972,82	0,12	TWD WISTRON	100.000,00	64.239,20	0,07
EUR REXEL	6.000,00	91.809,73	0,10	AUD WOODSIDE PETROLEUM	2.000,00	39.699,68	0,04
USD REYNOLDS AMERICAN	4.000,00	198.800,00	0,21	AUD WORLEYPARSONS	11.000,00	52.833,90	0,05
JPY RICOH	6.500,00	56.616,02	0,06	USD WP GLIMCHER	2.500,00	25.550,00	0,03
GBP RIO TINTO	4.250,00	120.161,78	0,12	TWD WPG HOLDINGS	45.000,00	49.467,25	0,05
CAD RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3.000,00	62.907,70	0,07	HKD WYNN MACAU	20.000,00	31.307,48	0,03
CHF ROCHE HOLDINGS (cert. shares)	200,00	52.484,11	0,05	USD WYNN RESORTS	1.000,00	96.180,00	0,10
GBP ROYAL DUTCH SHELL -A-	3.000,00	72.375,43	0,08	HKD XINJI GLASS HOLDINGS	60.000,00	41.786,22	0,04
GBP ROYAL MAIL	15.000,00	118.114,96	0,12	HKD YUE YUEN INDUSTRIAL (HOLDINGS)	15.000,00	56.577,46	0,06
EUR RTL GROUP	500,00	44.869,54	0,05	HKD ZHEJIANG EXPRESSWAY -H-	74.000,00	69.350,19	0,07
TWD RUENTEX INDUSTRIES	20.000,00	29.405,92	0,03	CHF ZURICH INSURANCE GROUP (reg. shares)	300,00	72.570,49	0,08
USD SABRA HEALTH CARE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1.200,00	25.128,00	0,03				
NOK SALMAR	7.500,00	225.095,26	0,23	Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)		29.910.582,13	31,10
HKD SANDS CHINA	12.000,00	46.034,36	0,05	Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere:			
JPY SANKYO	2.000,00	74.568,32	0,08	Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)		29.910.582,13	31,10
EUR SANOFI	750,00	61.526,54	0,06	Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere: Anleihen			
EUR SAP SE	1.500,00	121.834,08	0,13	Anleihen			
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	2.000,00	129.381,92	0,13	USD ABU DHABI NATIONAL ENERGY (reg. -S-) S. 4	300.000,00	332.250,00	0,35
EUR SCOR REGPT	2.250,00	75.269,62	0,08	7.25%/08-01.08.2018			
USD SEAGATE TECHNOLOGY	4.500,00	101.520,00	0,11	USD ACTIVISION BLIZ -144A- 5.625%/13-15.09.2021	100.000,00	105.000,00	0,11
JPY SEKISUI HOUSE	3.500,00	62.675,26	0,07	USD AES CORPORATION 5.5%/14-15.03.2024	150.000,00	151.875,00	0,16
USD SELECT INCOME REIT	1.500,00	36.945,00	0,04	USD AES GENER (reg. -S-) 5.25%/11-15.08.2021	100.000,00	106.225,00	0,11
USD SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST	1.800,00	33.624,00	0,03	USD AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK 4.75%/14-29.07.2019	200.000,00	206.058,00	0,21
CAD SHAW COMMUNICATIONS (nv) -B-	4.000,00	76.690,98	0,08	TRY AKBANK TAS (reg. -S-) 7.5%/13-05.02.2018	300.000,00	95.389,63	0,10
EUR SIEMENS (reg. shares)	1.000,00	107.751,47	0,11	USD ALAM SYNERGY (reg. -S-) 9%/14-29.01.2019	200.000,00	201.816,00	0,21
SGD SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	20.000,00	56.218,51	0,06	USD ALCOA 5.4%/11-15.04.2021	100.000,00	103.625,00	0,11
HKD SINOPEC ENGINEERING (GROUP) -H-	85.000,00	74.625,60	0,08	USD ALCOA 6.75%/08-15.07.2018	100.000,00	108.250,00	0,11
HKD SJM HOLDINGS	35.000,00	22.437,89	0,02	USD ALFA BOND ISSUANCE (reg. -S-) 7.875%/10-25.09.2017	100.000,00	106.080,00	0,11
EUR SNAM	20.000,00	114.553,43	0,12	USD ALLIANZ SE (subordinated) 5.5%/12-PERPETUAL	400.000,00	418.360,00	0,44
USD SOUTHERN	2.500,00	123.600,00	0,13	USD ALLSTATE S. -B- 7.45%/09-16.05.2019	200.000,00	229.316,00	0,24
GBP SOUTH32	3.250,00	3.606,95	0,00	USD ALTRIA GROUP 10.2%/09-06.02.2039	200.000,00	360.936,00	0,38
NZD SPARK NEW ZEALAND	50.000,00	125.161,05	0,13	EUR AMERICA MOVIL 4.75%/10-28.06.2022	100.000,00	135.393,47	0,14
USD SPIRIT REALTY CAPITAL	3.000,00	34.350,00	0,04	USD ANGLGOLD ASHANTI HOLDINGS 8.5%/13-30.07.2020	100.000,00	106.375,00	0,11
GBP SSE	3.000,00	66.895,42	0,07	USD ARCELORMITTAL STEP UP 09-01.06.2019	100.000,00	117.881,00	0,12
USD STAG INDUSTRIAL	1.500,00	32.025,00	0,03	USD ARCELORMITTAL step up 12-25.02.2022	100.000,00	104.150,00	0,11
GBP STANDARD LIFE	20.000,00	98.712,96	0,10	GBP ASSICURAZIONI GENERALI (subordinated) (reg. -S-) FIX-TO-FRN 07-PERPETUAL	100.000,00	146.264,60	0,15
SGD STARHUB	12.000,00	30.767,65	0,03	USD AT&T 5.5%/08-01.02.2018	100.000,00	106.300,00	0,11
EUR STMICROELECTRONICS	15.000,00	89.789,18	0,09	EUR AVIS BUDGET FINANCE (reg. -S-) 6%/13-01.03.2021	100.000,00	115.638,84	0,12
AUD STOCKLAND TRUST	20.000,00	65.634,87	0,07	USD AVON PRODUCTS FIX-TO-FLOATER 5%/15-15.03.2023	100.000,00	74.750,00	0,08
JPY SUMITOMO	8.000,00	82.052,20	0,09	USD AXA (subordinated) 5.5%/13-PERPETUAL	400.000,00	415.040,00	0,43
AUD SUNCORP-METWAY	7.500,00	70.524,89	0,07	GBP BAA FUNDING (reg. -S-) C. B-1 S. 4 6.25%/10-10.09.2018	100.000,00	158.621,92	0,16
SGD SUNTEC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	25.000,00	30.233,79	0,03	USD BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA -144A- 5.75%/07-20.07.2017	100.000,00	103.960,00	0,11
THB SUPALAI PUBLIC (nvdr)	90.000,00	51.392,59	0,05	USD BANCO DAYCOVAL 5.75%/14-19.03.2019	150.000,00	153.187,50	0,16
SEK SWEDBANK -A-	2.800,00	61.542,55	0,06	USD BANCO DO BRASIL (reg. -S-) (subordinated) 5.875%/11-26.01.2022	200.000,00	191.240,00	0,20
HKD SWIRE PACIFIC -A-	11.500,00	124.058,47	0,13	USD BANCO NACIONAL DE COSTA RICA 6.25%/13-01.11.2023	200.000,00	199.288,00	0,21
USD SYMANTEC	7.000,00	121.520,00	0,13	USD BANCO NACIONAL DE DESENVOLVIMENTO ECONOMICO E SOCIAL (reg. -S-) 6.5%/09-10.06.2019	200.000,00	206.740,00	0,21
TWD SYNnex TECHNOLOGY INTERNATIONAL	45.000,00	44.706,80	0,05	USD BANCOLOMBIA 5.95%/11-03.06.2021	200.000,00	213.480,00	0,22
USD SYSCO	4.000,00	192.440,00	0,20	USD BANK OF AMERICA 5.7%/12-24.01.2022	100.000,00	114.547,00	0,12
TWD TAIWAN CEMENT	40.000,00	36.857,05	0,04	SGD BANK OF EAST ASIA (reg. -S-) S. -9- FIX-TO-FRN 12-13.09.2022	250.000,00	184.384,37	0,19
TWD TAIWAN MOBILE	15.000,00	51.284,04	0,05	USD BANK OF INDIA (reg. -S-) S. 5 6.25%/11-16.02.2021	200.000,00	221.842,00	0,23
JPY TAKEDA PHARMACEUTICAL	2.700,00	116.783,73	0,12	USD BANQUE PSA FINANCE (reg. -S-) 5.75%/11-04.04.2021	100.000,00	109.994,00	0,11
DKK TDC	10.000,00	50.076,76	0,05	EUR BARCLAYS BANK (subordinated) 6%/10-14.01.2021	150.000,00	195.241,79	0,20
EUR TELEFONICA	7.000,00	73.181,72	0,08	GBP BARRY CALLEBAUT SERVICES (reg. -S-) 5.5%/13-15.06.2023	200.000,00	216.200,00	0,22
BRL TELEFONICA BRASIL (pref. shares)	2.000,00	23.259,45	0,02	USD BAYERISCHE LB (reg. -S-) S. 41 5.625%/06-23.05.2018	100.000,00	158.549,14	0,16
NOK TELENOR	3.000,00	50.005,23	0,05	USD BBVA BANCO CONTINENTAL (reg. -S-) 5%/12-26.08.2022	150.000,00	162.000,00	0,17
SEK TELE2-B-	4.500,00	39.433,78	0,04				
SEK TELIA COMPANY	10.000,00	46.796,19	0,05				
AUD TELSTRA	20.000,00	80.993,14	0,08				
CAD TELUS NON-CANADIAN	2.000,00	63.557,48	0,07				
USD THE RMR GROUP -A-	80,00	2.371,20	0,00				
TRY TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	8.000,00	60.006,65	0,06				
EUR TOTAL	2.000,00	97.242,39	0,10				
THB TOTAL ACCESS COMMUNICATION PUBLIC (nvdr)	30.000,00	31.280,62	0,03				
EUR TOTAL GABON	200,00	30.921,63	0,03				
BRL TOTVS	3.000,00	24.669,79	0,03				
BRL TRACTEBEL ENERGIA	3.000,00	29.550,45	0,03				
TWD TRANSCEND INFORMATION	10.000,00	28.578,01	0,03				

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Netto- vermögens	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Netto- vermögens
USD BCP SINGAPORE (reg. -S-) 8%/14-15.04.2021	50.000,00	41.500,00	0,04	USD EMPRESAS (reg. -S-) 7.625%/09-29.07.2019	100.000,00	114.250,00	0,12
USD BHARTI AIRTEL INTERNATIONAL NETHERLANDS (reg. -S-) 5.125%/13-11.03.2023	200.000,00	215.580,00	0,22	EUR ENEL SPA (subordinated) FIX-TO-FRN 13-10.01.2074	200.000,00	240.729,18	0,25
USD BIO-RAD LABORATORIES 4.875%/10-15.12.2020	200.000,00	217.714,00	0,23	USD ESKOM HOLDINGS SOC (reg. -S-) S. -2- 7.125%/15-11.02.2025	200.000,00	182.500,00	0,19
USD BOAD - BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEVELOPPMENT (reg. -S-) 5.5%/16-06.05.2021	200.000,00	204.750,00	0,21	USD ETRADE FINANCIAL 5.375%/14-15.11.2022	150.000,00	157.125,00	0,16
USD BOEING 4.875%/09-15.02.2020	200.000,00	222.138,00	0,23	USD EURASIAN DEVELOPMENT BANK (reg. -S-) 5%/13-26.09.2020	200.000,00	205.980,00	0,21
USD BOMBARDIER (reg. -S-) 6.125%/13-15.01.2023	100.000,00	85.875,00	0,09	USD FIAT CHRYSLER AUTO -A- 5.25%/15-15.04.2023	200.000,00	198.500,00	0,21
USD BOMBARDIER (reg. -S-) 7.5%/10-15.03.2018	100.000,00	102.250,00	0,11	EUR FINMECCANICA FINANCE 5.75%/03-12.12.2018	100.000,00	125.140,43	0,13
EUR BOPARAN HOLDINGS (reg. -S-) 4.375%/14-15.07.2021	100.000,00	105.814,41	0,11	GBP FIRSTGROUP 5.25%/12-29.11.2022	100.000,00	160.289,93	0,17
USD BP CAPITAL MARKETS 4.75%/09-10.03.2019	200.000,00	215.932,00	0,22	USD FORD HOLDINGS 9.375%/90-01.03.2020	100.000,00	122.389,00	0,13
USD BPCE (subordinated) T. 3 (reg. -S-) 4.625%/14-11.07.2024	200.000,00	198.920,00	0,21	USD FORD MOTOR CREDIT 8.125%/09-15.01.2020	100.000,00	118.440,00	0,12
USD BRASKEM FINANCE (reg. -S-) 7%/10-07.05.2020	100.000,00	104.250,00	0,11	USD FRANCE TELECOM 5.375%/09-08.07.2019	100.000,00	110.470,00	0,11
GBP BRITISH AIRWAYS R/L STEP UP 01-23.08.2016	100.000,00	147.181,58	0,15	USD FRESNILLO (reg. -S-) 5.5%/13-13.11.2023	200.000,00	214.304,00	0,22
GBP BRITISH AMERICAN TOBACCO HOLDINGS BV s. 30 5.5%/06-15.09.2016	150.000,00	221.099,85	0,23	USD FRONTIER COMMUNICATIONS 8.25%/10-15.04.2017	100.000,00	105.250,00	0,11
GBP BT GROUP STEP UP 01-07.12.2016	200.000,00	301.640,72	0,31	EUR GARNET 7.25%/13-01.08.2018	100.000,00	114.252,85	0,12
EUR CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 3.9%/11-20.10.2023	95.000,00	134.154,97	0,14	USD GAZ CAPITAL (reg. -S-) 9.25%/09-23.04.2019	100.000,00	114.590,00	0,12
EUR CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 5.375%/09-08.07.2024	85.000,00	132.325,35	0,14	USD GCX (REG. -S-) 7%/14-01.08.2019	200.000,00	192.302,00	0,20
USD CAR (reg. -S-) 6.125%/15-04.02.2020	200.000,00	206.462,00	0,21	USD GECC FIX-TO-FRN 15-PERPETUAL	246.000,00	240.506,82	0,25
USD CASE NEW HOLLAND 7.875%/11-01.12.2017	100.000,00	106.964,00	0,11	USD GECC 6.75%/02-15.03.2032	100.000,00	137.293,00	0,14
USD CATERPILLAR FINANCIAL SERVICES S.-F. T. - 820- 7.05%/08-01.10.2018	200.000,00	224.420,00	0,23	USD GEELY AUTOMOBILE (reg. -S-) 5.25%/14-06.10.2019	200.000,00	209.778,00	0,22
USD CBQ FINANCE (reg. -S-) subordinated 7.5%/09-18.11.2019	200.000,00	229.486,00	0,24	USD GENERAL MOTORS FINANCIAL 4.375%/14-25.09.2021	100.000,00	104.902,00	0,11
USD CDW LLC & CDW FINANCE CORP 5%/15-01.09.2023	50.000,00	50.437,50	0,05	USD GERDAU TRADE (reg. -S-) 5.75%/10-30.01.2021	200.000,00	185.500,00	0,19
USD CEMEX SAB DE CV (reg. -S-) 6.125%/15-05.05.2025	200.000,00	194.412,00	0,20	USD GILEAD SCIENCES 4.5%/11-01.04.2021	200.000,00	222.240,00	0,23
USD CENCOSUD (reg. -S-) 5.5%/11-20.01.2021	150.000,00	159.555,00	0,17	GBP GLENCORE FINANCE S. 7 6.5%/07-27.02.2019	200.000,00	303.969,54	0,32
USD CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS (reg. -S-) 5.75%/11-27.10.2021	200.000,00	171.000,00	0,18	USD GOLDMAN SACHS GROUP T. 580 5.375%/10-15.03.2020	100.000,00	110.440,00	0,11
USD CENTRAL BK TUNISIA (reg. -S-) 5.75%/15-30.01.2025	200.000,00	178.980,00	0,19	USD GOLDMAN SACHS GROUP 6.125%/03-15.02.2033	100.000,00	122.736,00	0,13
USD CFF 5.625%/07-19.06.2017	100.000,00	104.340,00	0,11	USD GOODYEAR TIRE & RUBBER 7%/12-15.05.2022	100.000,00	107.375,00	0,11
USD CHALIECO HK FIX TO FRN 6.875%/14-PERPETUAL	200.000,00	203.000,00	0,21	EUR GROUPEAMA (subordinated) FIX-TO-FRN 6.298%/07-PERPETUAL	100.000,00	109.621,73	0,11
USD CHINA CINDA FINANCE (reg. -S-) 5.625%/14-14.05.2024	200.000,00	216.262,00	0,22	USD HALLIBURTON 7.45%/09-15.09.2039	200.000,00	262.214,00	0,27
USD CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS FRN 14-PERPETUAL	200.000,00	210.062,00	0,22	USD HCA 5.25%/14-15.04.2025	100.000,00	103.000,00	0,11
USD CISCO SYSTEMS 5.5%/09-15.01.2040	200.000,00	253.768,00	0,26	EUR HEIDELBERGCEMENT 8%/09-31.01.2017	100.000,00	117.030,41	0,12
USD CIT GROUP 5%/12-15.08.2022	100.000,00	102.370,00	0,11	EUR HEIDELBERGCEMENT 8.5%/09-31.10.2019	50.000,00	69.333,21	0,07
USD CITIC (reg. -S-) S. 1 6.625%/11-15.04.2021	100.000,00	116.981,00	0,12	EUR HEMA BONDOCO I (reg. -S-) 6.25%/14-15.06.2019	100.000,00	86.566,32	0,09
USD CITIGROUP S. -O- FIX-TO-FRN (subordinated) 15-PERPETUAL	100.000,00	96.870,00	0,10	USD HKCG FINANCE T. -A- (reg. -S-) 6.25%/08-07.08.2018	200.000,00	217.940,00	0,23
USD CITIGROUP 6.125%/07-21.11.2017	150.000,00	159.192,00	0,17	USD HRVATSKA ELEKTROPRIVREDNA (reg. -S-) 5.875%/15-23.10.2022	200.000,00	208.750,00	0,22
USD CITY BUENOS AIRES (reg. -S-) 7.5%/16-01.06.2027	250.000,00	253.357,50	0,26	HUFG HUNGARY S. A 5.5%/13-20.12.2018	25.000.000,00	97.190,61	0,10
USD COLBUN (reg. -S-) 6%/10-21.01.2020	150.000,00	166.503,00	0,17	HUFG HUNGARY S. A 7.5%/04-12.11.2020	25.000.000,00	108.311,04	0,11
COP COLOMBIA 7.75%/10-14.04.2021	250.000.000,00	80.550,16	0,08	USD HUNGARY 7.625%/11-29.03.2041	100.000,00	140.320,00	0,15
USD COLOMBIA 8.125%/04-21.05.2024	100.000,00	124.785,00	0,13	USD HUTCHISON WHAMPOA INTERNATIONAL (reg. -S-) 7.625%/09-09.04.2019	150.000,00	172.963,50	0,18
USD COMCAST 6.5%/05-15.11.2035	100.000,00	134.593,00	0,14	EUR IBERDROLA FINANZAS 5.625%/08-09.05.2018	50.000,00	61.679,62	0,06
USD COMCEL TRUST (reg. -S-) 6.875%/14-06.02.2024	200.000,00	185.750,00	0,19	USD IBCB ASIA (reg. -S-) (subordinated) 5.125%/10-30.11.2020	150.000,00	162.960,00	0,17
EUR COMMERZBANK S. 774 7.75%/11-16.03.2021	100.000,00	134.669,85	0,14	USD ICICI BANK (reg. -S-) 5.75%/10-16.11.2020	200.000,00	223.340,00	0,23
USD CONTROLADORA MABE (reg. -S-) 7.875%/09-28.10.2019	100.000,00	111.000,00	0,12	USD INDIAN OIL 5.75%/13-01.08.2023	200.000,00	223.860,00	0,23
USD COSTA RICA (reg. -S-) 7%/14-04.04.2044	200.000,00	182.800,00	0,19	USD INDONESIA (reg. -S-) 11.625%/09-04.03.2019	100.000,00	124.050,00	0,13
USD COSTA RICA (reg. -S-) 7.158%/15-12.03.2045	200.000,00	185.174,00	0,19	USD INDONESIA (reg. -S-) 5.875%/10-13.03.2020	100.000,00	110.480,00	0,11
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS (reg. -S-) 7.5%/13-10.01.2023	200.000,00	209.750,00	0,22	USD INDONESIA (reg. -S-) 8.5%/05-12.10.2035	100.000,00	138.561,30	0,14
EUR CRH FINANCE (reg. -S-) S. 3 3.5%/12-25.01.2019	100.000,00	125.274,02	0,13	EUR ING BANK S. 3 5.25%/08-05.06.2018	100.000,00	123.570,75	0,13
USD CROATIA (reg. -S-) 6.25%/12-27.04.2017	200.000,00	207.160,00	0,22	EUR INTESA SANPAOLO (subordinated) FIX-TO-FRN 8.375%/09-PERPETUAL	100.000,00	127.044,09	0,13
USD CROATIA (reg. -S-) 6.375%/11-24.03.2021	200.000,00	217.360,00	0,23	USD ISRAEL ELECTRIC (reg. -S-) 5.625%/13-21.06.2018	200.000,00	211.912,00	0,22
USD DAI-ICHI LIFE INSURANCE FIX-TO-FLOATER 5.1%/14-PERPETUAL	200.000,00	221.712,00	0,23	EUR ITALCEMENTI FINANCE S. 1 STEP UP 10-19.03.2020	150.000,00	199.550,06	0,21
USD DELHI INTERNATIONAL AIRPORT (reg. -S-) 6.125%/15-03.02.2022	200.000,00	208.294,00	0,22	USD ITALY 5.375%/07-12.06.2017	200.000,00	207.490,00	0,22
USD DELL 4.625%/11-01.04.2021	150.000,00	152.625,00	0,16	USD JAFZ SUKUK 7%/12-19.06.2019	200.000,00	223.120,00	0,23
USD DEPPA ACS BANK (reg. -S-) 5.125%/07-16.03.2037	100.000,00	130.100,00	0,14	GBP JAGUAR LAND ROVER (reg. -S-) 5%/14-15.02.2022	100.000,00	151.294,86	0,16
EUR DEUTSCHE RASTSTATTEN GRUPPE IV (reg. -S-) 6.75%/13-30.12.2020	100.000,00	118.561,13	0,12	USD KALLPA GENERACION (reg. -S-) 4.875%/16-24.05.2026	200.000,00	200.826,00	0,21
USD DISH DBS 6.75%/11-01.06.2021	100.000,00	103.630,00	0,11	USD KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY (reg. -S-) 6.375%/10-06.10.2020	200.000,00	203.620,00	0,21
USD DOLPHIN ENERGY (reg. -S-) 5.5%/12-15.12.2021	200.000,00	223.740,00	0,23	USD KING POWER CAPITAL 5.625%/14-03.11.2024	200.000,00	217.760,00	0,23
USD DP WORLD (reg. -S-) S. 1 6.85%/07-02.07.2037	100.000,00	105.410,00	0,11	USD KINGDOM OF SAUDI ARABIA 6.125%/12-05.07.2022	200.000,00	201.860,00	0,21
USD DUBAI ELECTRICITY & WATER AUTHORITY (reg. -S-) 7.375%/10-21.10.2020	150.000,00	176.625,00	0,18	USD KMG FINANCE (reg. -S-) 7%/10-05.05.2020	200.000,00	215.240,00	0,22
USD ECOPETROL 7.625%/09-23.07.2019	200.000,00	222.480,00	0,23	EUR KONINKLIJKE KPN FIX-TO-FRN 6.125%/13-PERPETUAL	100.000,00	118.149,22	0,12
USD EDF (subordinated) FIX-TO-FRN 5.25%/13-PERPETUAL	200.000,00	190.688,00	0,20	USD KONINKLIJKE KPN -144A- 8.375%/00-01.10.2030	150.000,00	200.475,00	0,21
NOK EIB 5.25%/08-02.10.2017	1.500.000,00	188.559,88	0,20	EUR KONINKLIJKE KPN 5.625%/09-30.09.2024	100.000,00	149.097,57	0,16
USD EL SALVADOR (reg. -S-) 7.375%/09-01.12.2019	100.000,00	99.487,00	0,10	USD KUWAIT PROJECTS COMPANY (reg. -S-) S. 3 8.875%/09-17.10.2016	200.000,00	205.500,00	0,21
USD EMAAR SUKUK AL UJARA S. -2- 6.4%/12-18.07.2019	200.000,00	221.250,00	0,23	EUR LAFARGE 6.625%/10-29.11.2018	200.000,00	250.681,64	0,26
USD EMBOTELLADORA ANDINA (reg. -S-) 5%/13-01.10.2023	200.000,00	215.320,00	0,22	USD LEBANESE REPUBLIC (reg. -S-) S. 52 9%/09-20.03.2017	50.000,00	51.810,00	0,05
USD EMBRAER OVERSEAS 6.375%/09-15.01.2020	200.000,00	213.618,00	0,22	USD LEVI STRAUSS 6.875%/12-01.05.2022	100.000,00	106.708,00	0,11
USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO (reg. -S-) 6.25%/09-08.07.2019	100.000,00	109.384,80	0,11	USD LITHUANIA (reg. -S-) 7.375%/10-11.02.2020	200.000,00	235.860,00	0,25
USD EMPRESAS DE ENERGIA DE BOGOTA (reg. -S-) 6.125%/11-10.11.2021	200.000,00	206.640,00	0,21	USD LLOYDS BANK (subordinated) 4.5%/14-04.11.2024	200.000,00	202.860,00	0,21
				USD LUKOIL INTERNATIONAL FINANCE 6.356%/07-07.06.2017	100.000,00	104.192,00	0,11
				USD MACQUARIE GROUP (reg. -S-) T. 1 7.625%/09-13.08.2019	100.000,00	114.523,33	0,12

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermögens	Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Nettovermögens
USD MAJAPAHIT HOLDINGS (reg. -S-) 7.75%/09-20.01.2020	100.000,00	113.870,00	0,12	USD SUMITOMO LIFE INSURANCE (subordinated) (reg. -S-) FIX-TO-FRN 13-20.09.2073	200.000,00	235.524,00	0,24
USD MAJAPAHIT HOLDINGS (reg. -S-) 7.875%/07-29.06.2037	100.000,00	120.850,00	0,13	USD TANNER SERVICIOS FINANCIEROS (reg. -S-) 4.375%/13-13.03.2018	100.000,00	100.217,00	0,10
EUR MARCOLIN (reg. -S-) 8.5%/13-15.11.2019	100.000,00	116.666,37	0,12	USD TATA MOTORS 5.75%/14-30.10.2024	200.000,00	214.242,00	0,22
USD MDC (reg. -S-) S. -7- 5.5%/11-20.04.2021	200.000,00	227.500,00	0,24	USD TELECOM ITALIA CAPITAL S. C 6.375%/04-15.11.2033	100.000,00	99.226,00	0,10
USD MENDOZA PROVINCE 8.375%/16-19.05.2024	150.000,00	148.012,50	0,15	EUR TELECOM ITALIA 7%/11-20.01.2017	100.000,00	116.045,18	0,12
USD MERRILL LYNCH T. 677 6.875%/08-25.04.2018	150.000,00	163.638,00	0,17	USD TELEFONICA CELULAR DEL PARAGUAY (reg. -S-) 6.75%/12-13.12.2022	200.000,00	200.250,00	0,21
EUR METROPOLITANO DE LISBOA 5.75%/09-04.02.2019	100.000,00	122.323,91	0,13	EUR TELEFONICA EUROPE (subordinated) FIX-TO-FRN 5.875%/14-PERPETUAL	100.000,00	113.339,98	0,12
MXN MEXICO 6.5%/10-10.06.2021	15.000,00	84.601,03	0,09	USD TENET HEALTHCARE 6.25%/11-01.11.2018	100.000,00	105.750,00	0,11
MXN MEXICO 8.5%/09-13.12.2018	30.000,00	176.567,11	0,18	GBP THAMES WATER KEMBLE FINANCE 7.75%/11-01.04.2019	100.000,00	162.444,10	0,17
USD MGM RESORTS INTERNATIONAL 6.625%/12-15.12.2021	100.000,00	108.000,00	0,11	USD THE CHEMOURS 6.625%/15-15.05.2023	150.000,00	134.812,50	0,14
USD MICROSOFT 4.2%/15-03.11.2035	250.000,00	276.977,50	0,29	EUR THOMAS COOK FINANCE (reg. -S-) 7.75%/13-15.06.2020	100.000,00	115.321,57	0,12
USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR (reg. -S-) 6%/15-15.03.2025	200.000,00	186.000,00	0,19	USD TIME WARNER CABLE 6.55%/07-01.05.2037	100.000,00	112.812,00	0,12
USD MINSUR (reg. -S-) 6.25%/14-07.02.2024	200.000,00	193.250,00	0,20	USD T-MOBILE USA 6.731%/13-28.04.2022	100.000,00	105.130,00	0,11
USD MITRA PINASTHIKA MUSTIKA 6.75%/14-19.09.2019	200.000,00	199.832,00	0,21	USD TURK GARANTI BANKASI (reg. -S-) 6.25%/11-20.04.2021	200.000,00	212.500,00	0,22
EUR MOL HUNGARIAN OIL AND GAS 5.875%/10-20.04.2017	100.000,00	116.531,67	0,12	USD TURKCELL ILETISIM HIZMET (reg. -S-) 5.75%/15-15.10.2025	200.000,00	198.296,00	0,21
EUR MORGAN STANLEY 5.375%/10-10.08.2020	150.000,00	199.165,99	0,21	USD TURKEY 7.375%/05-05.02.2025	200.000,00	237.360,00	0,25
USD MOROCCO (reg. -S-) 4.25%/12-11.12.2022	200.000,00	206.320,00	0,21	TRY TURKIYE GARANTI BANKASI (reg. -S-) 7.375%/13-07.03.2018	300.000,00	94.690,37	0,10
USD MYRIAD INTERNATIONAL HOLDINGS (reg. -S-) 6.375%/10-28.07.2017	100.000,00	104.304,00	0,11	USD TURKIYE SINAI KALKINMA BANKASI 5.125%/15-22.04.2020	200.000,00	201.500,00	0,21
USD NAMIBIA (reg. -S-) 5.5%/11-03.11.2021	200.000,00	208.620,00	0,22	USD TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O. (reg. -S-) 5%/13-31.10.2018	200.000,00	204.474,00	0,21
USD NCR 6.375%/14-15.12.2023	100.000,00	101.750,00	0,11	USD TV AZTECA (reg. -S-) 7.625%/13-18.09.2020	100.000,00	61.625,00	0,06
USD NIPPON LIFE INSURANCE (subordinated) (reg. -S-) FIX-TO-FLOATER 5.1%/14-16.10.2044	200.000,00	217.798,00	0,23	EUR UBS CAPITAL SECURITIES (subordinated) FIX-TO-FLOATER (reg. -S-) 7.152%/07-PERPETUAL	100.000,00	121.177,26	0,13
USD NOKIA 5.375%/09-15.05.2019	100.000,00	106.750,00	0,11	EUR UNICREDIT INTERNATIONAL (subordinated) FIX-TO-FRN 8.125%/09-PERPETUAL	50.000,00	62.202,84	0,06
USD NORD LB COVERED FINANCE BANK 5.375%/07-05.06.2017	100.000,00	103.620,00	0,11	EUR UNICREDIT (reg. -S-) 5.25%/11-30.04.2023	100.000,00	148.028,85	0,15
USD NTPC 5.625%/11-14.07.2021	200.000,00	225.102,00	0,23	USD UNICREDIT S. 557 (subordinated) FIX-TO-FRN 13-02.05.2023	200.000,00	206.906,00	0,22
USD ODERBRECHT DRILLING (reg. -S-) 6.35%/10-30.06.2021	120.000,00	25.080,75	0,03	EUR UNICREDIT 5%/14-31.10.2021	100.000,00	140.436,49	0,15
GBP ORANGE FIX-TO-FRN 5.875%/14-PERPETUAL	150.000,00	223.204,53	0,23	EUR UNIONE DI BANCHE ITALIANE BPI 5.25%/11-28.01.2021	100.000,00	138.098,66	0,14
USD PEMEX PROJECT FUNDING MASTER 5.75%/07-01.03.2018	100.000,00	104.162,00	0,11	USD US STEEL 7.375%/10-01.04.2020	100.000,00	86.000,00	0,09
USD PEPISCO 5%/08-01.06.2018	150.000,00	161.055,00	0,17	EUR VATTENFALL (reg. -S-) 6.25%/09-17.03.2021	100.000,00	140.291,77	0,15
USD PERU 7.125%/09-30.03.2019	200.000,00	229.000,00	0,24	USD VEDANTA RESOURCES (reg. -S-) 7.125%/13-31.05.2023	200.000,00	143.000,00	0,15
USD PERU 7.35%/05-21.07.2025	200.000,00	263.760,00	0,27	USD VERISIGN 4.625%/13-01.05.2023	50.000,00	50.893,00	0,05
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE 8.375%/16-23.05.2021	50.000,00	49.437,50	0,05	USD VERIZON COMMUNICATIONS 6.55%/13-15.09.2043	100.000,00	131.061,00	0,14
USD PETROBRAS INTERNATIONAL FINANCE 7.875%/09-15.03.2019	150.000,00	152.062,50	0,16	USD VIP FINANCE (reg. -S-) 7.748%/11-02.02.2021	200.000,00	217.580,00	0,23
USD PETROLEOS MEXICANOS PEMEX 6.5%/11-02.06.2041	100.000,00	94.300,00	0,10	USD VOLCAN (reg. -S-) 5.375%/12-02.02.2022	100.000,00	85.875,00	0,09
USD PETRONAS CAPITAL (reg. -S-) 7.875%/02-22.05.2022	200.000,00	255.428,40	0,27	USD VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE (reg. -S-) 4%/10-12.08.2020	150.000,00	157.660,50	0,16
EUR PEUGEOT 6.5%/13-18.01.2019	50.000,00	63.316,09	0,07	USD WALT DISNEY T. -55- 6%/07-17.07.2017	200.000,00	211.100,00	0,22
USD PFIZER 6.2%/09-15.03.2019	150.000,00	169.665,00	0,18	USD WESTERN DIGITAL (reg. -S-) 7.375%/16-01.04.2023	100.000,00	104.212,00	0,11
USD PHILIPPINES 10.625%/00-16.03.2025	200.000,00	326.240,00	0,34	EUR WIENERBERGER (subordinated) (reg. -S-) FIX-TO-FRN 6.5%/14-PERPETUAL	50.000,00	58.206,28	0,06
USD POLAND 6.375%/09-15.07.2019	200.000,00	226.900,00	0,24	USD WING HANG BANK (subordinated) FIX-TO-FRN 6%/07-PERPETUAL	200.000,00	206.344,00	0,21
USD PORTUGAL (reg. -S-) S 17 5.125%/14-15.10.2024	100.000,00	98.620,00	0,10	USD WOORI BANK (subordinated) (reg. -S-) T. -2- 5.875%/11-13.04.2021	200.000,00	227.356,00	0,24
EUR PORTUGAL 5.65%/13-15.02.2024	100.000,00	132.988,85	0,14	USD XEROX 6.35%/08-15.05.2018	100.000,00	107.201,69	0,11
USD OTEL INTERNATIONAL (reg. -S-) S. 2 7.875%/09-10.06.2019	150.000,00	174.898,50	0,18	USD ZF NORTH AMERICA CAP 4.75%/15-29.04.2025	150.000,00	150.000,00	0,16
USD RADIO ONE (reg. -S-) 7.375%/15-15.04.2022	50.000,00	47.875,00	0,05				
AUD RCI BANQUE (reg. -S-) S. 272 6%/12-18.10.2016	200.000,00	146.062,94	0,15	Anleihen		45.019.836,35	46,81
USD RELIANCE HLDGS (reg. -S-) 5.4%/12-14.02.2022	250.000,00	276.450,00	0,29	Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere:			
EUR REPUBLIC OF ALBANIA (reg. -S-) 5.75%/15-12.11.2020	100.000,00	118.570,03	0,12	Anleihen		45.019.836,35	46,81
EUR REPUBLIC OF MONTENEGRO (reg. -S-) 5.75%/16-10.03.2021	100.000,00	112.260,13	0,12				
USD REPUBLIC OF SLOVENIA (reg. -S-) 5.85%/13-10.05.2023	200.000,00	230.600,00	0,24	Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere: Investmentfonds			
USD RIO TINTO FINANCE USA 6.5%/08-15.07.2018	200.000,00	218.532,00	0,23				
USD ROCHE HOLDINGS (reg. -S-) 6%/09-01.03.2019	131.000,00	146.700,35	0,15	Fondsanteile (Closed-End)			
USD ROMANIA (reg. -S-) T. 1 6.75%/12-07.02.2022	200.000,00	235.960,00	0,25	USD ALLIANZGI CONVERTIBLE & INCOME FUND	530.000,00	3.164.100,00	3,29
EUR ROYAL BANK OF SCOTLAND (subordinated) 5.5%/04-PERPETUAL	100.000,00	108.898,12	0,11				
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND 5.625%/10-24.08.2020	100.000,00	110.992,00	0,12	Fondsanteile (Closed-End)		3.164.100,00	3,29
USD ROYAL BANK SCOTLAND 6.125%/11-11.01.2021	100.000,00	114.200,00	0,12				
USD SAN MIGUEL INDUSTRIAS PET (reg. -S-) 7.75%/13-06.11.2020	100.000,00	104.785,00	0,11	Fondsanteile (Open-End)			
GBP SCOTT WIDOWS (subordinated) (reg. -S-) 5.5%/13-16.06.2023	100.000,00	150.674,81	0,16	USD AXA FIIS US SHORT DURATION HIGH YIELD -A DIS-	16.000,00	1.424.320,00	1,48
CHF SELECTA GROUP (reg. -S-) 6.5%/14-150620	150.000,00	141.821,75	0,15	USD CREDIT SUISSE FUND (LUX) ASIA PACIFIC INCOME MAXIMISER EQUITY -DA-	2.300,00	1.964.775,00	2,04
EUR SELECTA GROUP (reg. -S-) 6.5%/14-150620	100.000,00	103.031,29	0,11	USD CS INVESTMENT FUNDS 2 SICAV - CS (Lux) GLOBAL PROPERTY INCOME MAXIMISER EQUITY -DA- USD	2.900,00	2.821.178,00	2,93
USD SIGMA ALIMENT (reg. -S-) 6.875%/09-16.12.2019	150.000,00	170.517,00	0,18	EUR DBX TRACKER ITRAXX CROSSOVER SHORT DAILY UCITS 1C	10.000,00	557.960,90	0,58
USD SIRIUS XM RADIO -144A- 6%/14-15.07.2024	100.000,00	105.500,00	0,11	USD PIMCO GLOBAL INVESTORS SERIES - MLP & ENERGY INFRASTRUCTURE FUND CLASS USD	75.000,00	530.250,00	0,55
EUR SOCIETE GENERALE 5%/09-27.03.2019	100.000,00	127.567,32	0,13	EUR PIONEER FUNDS FCP - EUROPEAN EQUITY TARGET INCOME -I- -EUR-	1.000,00	1.412.246,69	1,47
USD SOMPO JAPAN (subordinated) (reg. -S-) FIX-TO-FRN 13-28.03.2073	200.000,00	222.070,00	0,23	USD SOURCE MORNINGSTAR US ENERGY INFRASTRUCTURE MLP UCITS ETF -B- USD	65.000,00	4.205.175,00	4,38
ZAR SOUTH AFRICA S. R204 8%/04-21.12.2018	1.000.000,00	62.951,41	0,07	EUR THEAM QUANT SICAV - EQUITY EUROPE INCOME -I-	15.000,00	1.834.691,66	1,91
ZAR SOUTH AFRICA S. R207 7.25%/05-15.01.2020	1.500.000,00	91.012,82	0,09				
USD SOUTH AFRICA 5.875%/07-30.05.2022	150.000,00	161.145,00	0,17	Fondsanteile (Open-End)		14.750.597,25	15,34
USD SRI LANKA (reg. -S-) 6.125%/15-03.06.2025	200.000,00	183.500,00	0,19	Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere:			
USD SRI LANKA (reg. -S-) 6%/14-14.01.2019	200.000,00	202.740,00	0,21	Investmentfonds		17.914.697,25	18,63
USD STANDARD CHARTERED (subordinated) 5.875%/10-24.06.2020	200.000,00	222.174,00	0,23				
EUR STORA ENSO (reg. -S-) 5.5%/12-07.03.2019	100.000,00	124.528,15	0,13				

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Netto- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere: Zertifikate			
Zertifikate			
USD CS AG LONDON (CS US EQ ENHANC CALL WRITING INDEX)STRUCTURED PRODUCTS	6.000,00	610.800,00	0,64
USD JP MORGAN STRUCTURED PRODUCTS 15- 12.01.2021	6.000,00	615.060,00	0,63
Zertifikate		1.225.860,00	1,27
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere: Zertifikate			
		1.225.860,00	1,27
Total des Wertpapierbestandes		94.374.200,70	98,13
Bankguthaben und sonstige		707.992,37	0,74
Andere Nettovermögenswerte		1.089.004,38	1,13
Fondsvermögen		96.171.197,45	100,00

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.
Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B -Thesaurierend	USD	30782174	LU1335031537	1,50%	/
EB -Thesaurierend	USD	30782775	LU1335033079	1,00%	/
FB -Thesaurierend	USD	30782899	LU1335033319	0,70%	/
IB -Thesaurierend	USD	30782781	LU1335031883	1,00%	/
UB -Thesaurierend	USD	30782912	LU1335033749	1,25%	/
EBH -Thesaurierend	CHF	30782779	LU1335033236	1,00%	/
FBH -Thesaurierend	CHF	30782908	LU1335033582	0,70%	/
UBH -Thesaurierend	CHF	30782916	LU1335034044	1,25%	/
EBH -Thesaurierend	EUR	30782777	LU1335033152	1,00%	/
FBH -Thesaurierend	EUR	30782900	LU1335033400	0,70%	/
IBH -Thesaurierend	EUR	30782782	LU1335031966	1,00%	/
UBH -Thesaurierend	EUR	30782914	LU1335033822	1,25%	/
FBH -Thesaurierend	GBP	30782910	LU1335033665	0,70%	/
UBH -Thesaurierend	GBP	30993216	LU1341901590	1,25%	/

Credit Suisse (Lux) Multi-Advisor Equity Alpha Fund wurde am 29.01.2016 lanciert, der erste NIW wurde am 01.02.2016 berechnet. Für Aktienklassen, die weniger als 6 Monate vor Abschluss aufgelegt wurden, wird keine TER ausgewiesen.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung
B -Thesaurierend	USD	/	-2,45%
EB -Thesaurierend	USD	/	-2,27%
FB -Thesaurierend	USD	/	-2,17%
IB -Thesaurierend	USD	/	-2,29%
UB -Thesaurierend	USD	/	-2,37%
EBH -Thesaurierend	CHF	/	-2,78%
FBH -Thesaurierend	CHF	/	-2,68%
UBH -Thesaurierend	CHF	/	-2,88%
EBH -Thesaurierend	EUR	/	-2,55%
FBH -Thesaurierend	EUR	/	-2,46%
IBH -Thesaurierend	EUR	/	-2,58%
UBH -Thesaurierend	EUR	/	-2,65%
FBH -Thesaurierend	GBP	/	-2,18%
UBH -Thesaurierend	GBP	/	-2,38%

Erläuterungen

Finanzterminkontrakte

Beschreibung	Währung	Anzahl	Liquidationsbetrag	Bewertung
Gegenpartei				(in USD)
E-MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX -50- 06/16	USD	20,00	805.600,00	3.495,00
HANG SENG INDEX -50- 06/16	HKD	21,00	21.497.700,00	54.472,70
S&P E-MINI 500 STOCK INDEX -50- 06/16	USD	23,00	2.409.135,00	-1.027,50
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Finanzterminkontrakten				56.940,20

Gegenpartei: Credit Suisse Zürich

Technische Daten und Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in USD)
CHF	20.156,00	USD	-20.613,43	15.06.2016	-327,79
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	14.403,71	EUR	-12.848,00	15.06.2016	95,00
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
GBP	4.822.519,00	USD	-6.909.849,90	15.06.2016	109.437,42
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
CHF	81.629.573,00	USD	-83.141.503,63	15.06.2016	-986.889,22
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	4.010,94	CHF	-3.938,00	15.06.2016	47,59
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
EUR	49.411.254,00	USD	-55.053.525,09	15.06.2016	-24.804,45
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
CHF	64.897,00	USD	-66.028,60	22.06.2016	-696,27
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	48.174,19	EUR	-43.250,00	22.06.2016	-1,08
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	11.711,81	GBP	-8.277,00	22.06.2016	-335,47
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
EUR	178.353,00	USD	-197.925,28	15.06.2016	704,32
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	8.952,48	CHF	-8.834,00	15.06.2016	61,63
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
GBP	28.501,00	USD	-41.305,36	15.06.2016	178,50
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
CHF	13.679,00	USD	-14.202,75	15.06.2016	-435,77
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	12.373,50	EUR	-10.950,00	15.06.2016	178,54
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
CHF	148.149,00	USD	-153.509,87	15.06.2016	-4.407,98
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	36.573,72	GBP	-25.250,00	15.06.2016	-178,23
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
CHF	183.954,00	USD	-190.558,37	22.06.2016	-5.370,41
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	355.094,03	EUR	-314.454,00	22.06.2016	4.827,60
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	5.891,52	CHF	-5.701,00	15.06.2016	153,76
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
GBP	50.878,00	USD	-72.372,12	15.06.2016	1.681,98
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	181.018,12	EUR	-160.912,00	15.06.2016	1.811,65
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	4.027,79	EUR	-3.595,00	15.06.2016	24,07
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
EUR	539.878,00	USD	-604.872,83	15.06.2016	-3.617,18
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	178.565,98	CHF	-173.374,00	15.06.2016	4.074,57
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	1.237.457,21	CHF	-1.203.416,00	15.06.2016	26.286,28
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	32.557,94	EUR	-29.065,00	15.06.2016	188,53
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
CHF	2.395,00	USD	-2.460,37	15.06.2016	-49,97
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					

Technische Daten und Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in USD)
USD	131.518,35	EUR	-117.014,00	15.06.2016	1.200,78
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
CHF	31.325,00	USD	-32.296,64	15.06.2016	-770,16
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
CHF	1.086.485,00	USD	-1.131.354,52	15.06.2016	-37.881,25
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
EUR	13.720,00	USD	-15.581,72	15.06.2016	-301,92
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
CHF	1.353.109,00	USD	-1.416.160,72	15.06.2016	-54.348,52
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	1.346.324,46	KRW	-1.532.386.500,00	17.06.2016	60.873,15
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	24.214,57	EUR	-21.214,00	15.06.2016	588,56
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
CHF	4.859,00	USD	-5.065,42	15.06.2016	-175,17
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
EUR	1.924.529,00	USD	-2.188.066,30	15.06.2016	-44.741,45
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	37.350,15	EUR	-32.746,00	15.06.2016	880,98
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	1.802,76	CHF	-1.725,00	15.06.2016	66,63
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	28.159,07	EUR	-24.702,00	15.06.2016	648,49
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	13.389,60	GBP	-9.464,00	15.06.2016	-385,46
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	11.562,21	CHF	-11.041,00	15.06.2016	449,94
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
EUR	24.640,00	USD	-28.115,64	15.06.2016	-674,37
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	1.193.449,58	CHF	-1.138.058,00	15.06.2016	48.043,93
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	8.358,30	GBP	-5.925,00	15.06.2016	-265,68
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	162.256,09	EUR	-142.357,00	15.06.2016	3.713,35
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	24.426,22	GBP	-17.311,00	15.06.2016	-770,33
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	23.203,82	CHF	-22.098,00	15.06.2016	963,13
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
EUR	48.725,00	USD	-55.359,88	15.06.2016	-1.095,43
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	93.125,14	CHF	-88.508,00	15.06.2016	4.045,52
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	994.259,60	EUR	-867.340,00	15.06.2016	28.302,31
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
TWD	18.860.503,00	USD	-583.735,78	15.06.2016	-5.789,66
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
CHF	12.908,00	USD	-13.605,70	15.06.2016	-614,68
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	20.610,64	CHF	-19.683,00	15.06.2016	800,58
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	1.163.317,36	TWD	-37.627.500,00	15.06.2016	10.297,12
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					

Technische Daten und Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in USD)
USD	28.821,70	EUR	-25.292,00	15.06.2016	654,05
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	44.820,03	CHF	-43.127,00	15.06.2016	1.414,83
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	359.938,30	EUR	-318.155,00	15.06.2016	5.610,69
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	60.354,03	CHF	-58.198,00	15.06.2016	1.780,69
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
EUR	8.438,00	USD	-9.521,54	15.06.2016	-124,24
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	20.269,79	EUR	-17.929,00	15.06.2016	302,36
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	37.361,30	CHF	-36.072,00	15.06.2016	1.056,68
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	1.503.303,10	EUR	-1.326.401,00	15.06.2016	26.095,96
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	37.294,33	CHF	-35.878,00	15.06.2016	1.184,89
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	95.020,28	CHF	-91.028,00	15.06.2016	3.404,84
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	12.740,62	GBP	-8.847,00	15.06.2016	-136,40
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
EUR	67.689,00	USD	-77.120,24	15.06.2016	-1.735,81
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
TWD	37.627.500,00	USD	-1.174.391,39	15.06.2016	-21.364,47
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	58.851,20	CHF	-56.806,00	15.06.2016	1.678,88
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	84.722,58	EUR	-74.674,00	15.06.2016	1.558,43
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	12.497,41	CHF	-12.123,00	15.06.2016	296,27
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
CHF	9.845,00	USD	-10.093,83	15.06.2016	-185,51
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	864.743,66	CHF	-843.426,00	15.06.2016	15.884,07
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	672.133,82	EUR	-596.936,00	15.06.2016	7.330,47
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
EUR	8.544,00	USD	-9.644,53	15.06.2016	-129,18
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	1.085,02	CHF	-1.055,00	15.06.2016	23,22
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	37.901,68	GBP	-25.981,00	15.06.2016	85,73
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	9.293,28	EUR	-8.213,00	15.06.2016	146,50
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	4.287,20	CHF	-4.166,00	15.06.2016	94,36
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	196.617,51	EUR	-173.614,00	15.06.2016	3.264,39
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
CHF	6.845,00	USD	-7.052,34	15.06.2016	-163,31
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	65.377,17	EUR	-57.668,00	22.06.2016	1.141,35
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					

Technische Daten und Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in USD)
GBP	16.409,00	USD	-23.885,19	22.06.2016	-1,68
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
CHF	41.964,00	USD	-43.396,47	22.06.2016	-1.150,98
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	23.748,59	GBP	-16.190,00	22.06.2016	183,83
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	73.530,33	CHF	-70.390,00	22.06.2016	2.665,90
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	71.462,19	EUR	-62.334,00	22.06.2016	2.028,51
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	34.327,80	CHF	-32.748,00	15.06.2016	1.368,38
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	382.437,13	EUR	-331.930,00	15.06.2016	12.765,65
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
EUR	9.523,00	USD	-10.978,02	15.06.2016	-372,37
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	49.274,87	CHF	-46.908,00	15.06.2016	2.063,97
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	319.275,25	EUR	-277.503,00	15.06.2016	10.219,47
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	12.231,14	GBP	-8.449,00	15.06.2016	-66,58
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
CHF	39.061,00	USD	-40.859,17	15.06.2016	-1.546,93
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
EUR	42.970,00	USD	-49.123,95	15.06.2016	-1.268,78
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	42.710,88	CHF	-41.361,00	15.06.2016	1.083,24
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	234.957,08	EUR	-205.785,00	15.06.2016	5.774,53
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	58.325,68	CHF	-56.496,00	15.06.2016	1.465,47
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	76.904,65	CHF	-74.811,00	15.06.2016	1.611,58
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	14.686,19	EUR	-12.878,00	15.06.2016	343,98
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	84.340,25	EUR	-73.720,00	15.06.2016	2.238,29
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	22.294,06	CHF	-21.626,00	15.06.2016	528,66
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
CHF	5.135,00	USD	-5.301,64	15.06.2016	-133,61
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	81.940,97	EUR	-71.880,00	15.06.2016	1.888,34
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
EUR	4.908,00	USD	-5.547,64	15.06.2016	-81,66
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	40.681,60	CHF	-39.672,00	15.06.2016	754,02
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
EUR	57.760,00	USD	-65.533,57	15.06.2016	-1.206,95
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	2.127,24	GBP	-1.470,00	15.06.2016	-12,37
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	4.156,07	CHF	-4.052,00	15.06.2016	77,96
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					

Technische Daten und Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in USD)
USD	3.359,18	CHF	-3.294,00	15.06.2016	43,97
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
EUR	87.292,00	USD	-98.539,23	15.06.2016	-1.323,18
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	18.071,97	CHF	-17.872,00	15.06.2016	84,98
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	90.841,46	EUR	-80.990,00	15.06.2016	643,61
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	221.035,53	CHF	-219.086,00	15.06.2016	540,26
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	73.378,17	EUR	-65.460,00	15.06.2016	475,97
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	30.258,83	CHF	-29.974,00	15.06.2016	92,01
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	148.256,46	GBP	-101.584,00	15.06.2016	398,61
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	164.458,97	EUR	-147.338,00	15.06.2016	370,27
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	12.787,44	CHF	-12.688,00	15.06.2016	17,83
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	61.190,20	CHF	-60.668,00	15.06.2016	131,96
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	40.805,62	EUR	-36.617,00	15.06.2016	25,69
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	6.897,50	GBP	-4.690,00	15.06.2016	71,10
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	695.846,00	CHF	-688.509,00	15.06.2016	2.907,46
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	147.997,21	EUR	-132.275,00	15.06.2016	683,86
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	84.744,21	CHF	-84.036,00	15.06.2016	167,67
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	17.806,21	EUR	-15.983,00	15.06.2016	6,13
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	32.179,04	CHF	-31.944,00	15.06.2016	29,59
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
USD	273.491,28	EUR	-245.434,00	15.06.2016	154,32
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
GBP	19.983,00	USD	-29.006,88	15.06.2016	78,84
<i>JPMorgan Chase Bank (New York)</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-768.311,43

Swapkontrakte

Art	Verbindlichkeiten	Fälligkeit	Forderungen	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>	Nennwert		Nennwert	(in USD)
TRS	Pos. Perf. AIR FP Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month - 40 Bps)	18.05.2017 EUR	Neg. Perf. AIR FP Equity + ICE LIBOR USD 1 Month - 40 Bps	-128.265,64
<i>BNP Paribas Paris - Paris - France</i>				

Technische Daten und Erläuterungen

Swapkontrakte

Art	Verbindlichkeiten	Fälligkeit	Forderungen	Bewertung
Gegenpartei	Nennwert		Nennwert	(in USD)
TRS	Pos. Perf. BDX US Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps)	26.04.2017 USD	2.521.225,20 Neg. Perf. BDX US Equity + ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps	11.195,78
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. BNR GY Equity - (ICE LIBOR EUR 1M - 40 Bps)	27.06.2017 EUR	2.154.886,54 Neg. Perf. BNR GY Equity + ICE LIBOR EUR 1M - 40 Bps	7.716,55
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Perf. BP US Equity - (US0001M + - 35 Bps)	05.04.2017 USD	1.551.083,28 Neg. Perf. BP US Equity + (US0001M + -35 Bps)	8.938,51
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. CELG US Equity - (US0001M + - 35 Bps)	05.04.2017 USD	1.025.033,38 Neg. Perf. CELG US Equity + (US0001M + -35 Bps)	-38.332,66
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. CMI US Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps)	10.05.2017 USD	1.403.751,87 Neg. Perf. CMI US Equity + ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps	-8.184,44
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. CMI US Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps)	11.05.2017 USD	326.923,50 Neg. Perf. CMI US Equity + ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps	-2.079,38
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. DSY FP Equity - (ICE LIBOR EUR 1M - 40 Bps)	26.04.2017 EUR	915.337,15 Neg. Perf. DSY FP Equity + ICE LIBOR EUR 1M - 40 Bps	-7.420,97
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. FM CN Equity - (Canada Bankers Acceptances 1 M - 35 Bps)	12.05.2017 CAD	872.842,86 Neg. Perf. FM CN Equity + Canada Bankers Acceptances 1 M - 35 Bps	-15.132,22
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. FXI US Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month - 45 Bps)	05.05.2017 USD	3.224.511,69 Neg. Perf. FXI US Equity + ICE LIBOR USD 1 Month - 45 Bps	-135.840,89
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. GS US Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps)	24.04.2017 USD	793.883,15 Neg. Perf. GS US Equity + ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps	-23.883,82
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. HEXAB SS Equity - (STIBOR Interbank Offered Rate - 70 Bps)	10.04.2017 SEK	4.808.746,55 Neg. Perf. HEXAB SS Equity + STIBOR Interbank Offered Rate - 70 Bps	-13.977,74
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. IBM US Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps)	09.05.2017 USD	665.931,60 Neg. Perf. IBM US Equity + ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps	-28.937,12
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. ILMN US Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps)	04.05.2017 USD	1.394.811,60 Neg. Perf. ILMN US Equity + ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps	-101.916,59
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. JNJ US Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps)	11.04.2017 USD	2.265.212,22 Neg. Perf. JNJ US Equity + ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps	17.535,81
BNP Paribas Paris - Paris - France				

Technische Daten und Erläuterungen

Swapkontrakte

Art	Verbindlichkeiten	Fälligkeit	Forderungen	Bewertung
Gegenpartei	Nennwert		Nennwert	(in USD)
TRS	Pos. Perf. LIN GY Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month - 50 Bps)	18.05.2017	EUR 2.190.962,24	Neg. Perf. LIN GY Equity + ICE LIBOR USD 1 Month - 50 Bps -129.568,42
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. MDT US Equity - (US0001M + - 35 Bps)	05.04.2017	USD 632.025,00	Neg. Perf. MDT US Equity + (US0001M + -35 Bps) -7.751,22
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. MOS US Equity - (US0001M + - 35 Bps)	05.04.2017	USD 959.926,56	Neg. Perf. MOS US Equity + (US0001M + -35 Bps) 21.224,44
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. NOVOB DC Equity - (CIB001M - 75 Bps)	05.04.2017	DKK 2.468.052,00	Neg. Perf. NOVOB DC Equity + (CIB001M - 75 Bps) -14.451,69
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. PH US Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps)	17.05.2017	USD 1.760.676,40	Neg. Perf. PH US Equity + ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps -46.844,47
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. POT US Equity - (US0001M - 60 Bps)	05.04.2017	USD 933.440,00	Neg. Perf. POT US Equity + (US0001M - 60 Bps) -19.361,99
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. PX US Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps)	09.05.2017	USD 1.678.120,96	Neg. Perf. PX US Equity + ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps 47.010,59
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. RMG LN Equity - (ICE LIBOR GBP 1 Month - 50 Bps)	25.05.2017	GBP 1.133.426,55	Neg. Perf. RMG LN Equity + ICE LIBOR GBP 1 Month - 50 Bps -48.582,39
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. ROG VX Equity - (SF0001M + - 50 Bps)	05.04.2017	CHF 652.202,60	Neg. Perf. ROG VX Equity + (SF0001M + - 50 Bps) -75.682,15
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. SMH US Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month - 85 Bps)	04.05.2017	USD 3.390.394,14	Neg. Perf. SMH US Equity + ICE LIBOR USD 1 Month - 85 Bps -344.948,93
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. TGT US Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps)	04.05.2017	USD 1.048.931,70	Neg. Perf. TGT US Equity + ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps 136.415,54
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. TMO US Equity - (US0001M + - 35 Bps)	05.04.2017	USD 645.873,00	Neg. Perf. TMO US Equity + (US0001M + -35 Bps) -29.462,85
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. TXN US Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps)	30.05.2017	USD 1.324.588,11	Neg. Perf. TXN US Equity + ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps 8.917,21
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. UNP US Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps)	09.05.2017	USD 1.673.360,50	Neg. Perf. UNP US Equity + ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps -2.282,35
BNP Paribas Paris - Paris - France				

Technische Daten und Erläuterungen

Swapkontrakte

Art	Verbindlichkeiten	Fälligkeit	Forderungen	Bewertung
Gegenpartei	Nennwert		Nennwert	(in USD)
TRS	Pos. Perf. UNP US Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps)	11.05.2017 USD	278.784,00 Neg. Perf. UNP US Equity + ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps	-844,89
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Perf. WDAY US Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps)	11.04.2017 USD	316.802,64 Neg. Perf. WDAY US Equity + ICE LIBOR USD 1 Month - 35 Bps	-18.698,62
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. ABBV US Equity	03.04.2017 USD	2.135.101,44 Neg. Var. ABBV US Equity + LIBOR	-51.631,50
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. ACN US Equity	23.03.2017 USD	436.720,62 Neg. Var. ACN US Equity + LIBOR	-10.478,29
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. ACN US Equity	16.03.2017 USD	1.399.305,28 Neg. Var. ACN US Equity + LIBOR	-59.993,73
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. ADP US Equity	01.02.2017 USD	814.796,73 Neg. Var. ADP US Equity + LIBOR	14.575,59
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. ADP US Equity	09.02.2017 USD	339.924,00 Neg. Var. ADP US Equity + LIBOR	-2.633,58
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. ADP US Equity	17.02.2017 USD	405.497,85 Neg. Var. ADP US Equity + LIBOR	-11.816,00
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. ADP US Equity	21.03.2017 USD	483.282,25 Neg. Var. ADP US Equity + LIBOR	-14.672,40
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. APH US Equity	03.02.2017 USD	220.151,40 Neg. Var. APH US Equity + LIBOR	-12.146,96
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. APH US Equity	08.02.2017 USD	484.241,57 Neg. Var. APH US Equity + LIBOR	-21.957,32
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. APH US Equity	24.02.2017 USD	557.703,98 Neg. Var. APH US Equity + LIBOR	-10.636,68
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. APH US Equity	09.02.2017 USD	338.087,23 Neg. Var. APH US Equity + LIBOR	-15.330,13
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. APH US Equity	31.03.2017 USD	399.742,80 Neg. Var. APH US Equity + LIBOR	-20.661,93
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. APH US Equity	01.02.2017 USD	357.251,00 Neg. Var. APH US Equity + LIBOR	-15.581,93
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. APH US Equity	21.03.2017 USD	991.661,04 Neg. Var. APH US Equity + LIBOR	-41.320,04
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. APH US Equity	10.03.2017 USD	422.661,75 Neg. Var. APH US Equity + LIBOR	-23.320,57
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. AVGO US Equity	21.03.2017 USD	481.325,00 Neg. Var. AVGO US Equity + LIBOR	-20.334,73
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. AVGO US Equity	08.02.2017 USD	360.272,00 Neg. Var. AVGO US Equity + LIBOR	-30.239,28
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. AVGO US Equity	03.02.2017 USD	245.522,76 Neg. Var. AVGO US Equity + LIBOR	-20.287,44
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				

Technische Daten und Erläuterungen

Swapkontrakte

Art	Verbindlichkeiten	Fälligkeit	Forderungen	Bewertung
Gegenpartei	Nennwert		Nennwert	(in USD)
TRS	Pos. Var. AVGO US Equity	01.02.2017	USD 660.281,60	Neg. Var. AVGO US Equity + LIBOR -37.353,40
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. CABK SM Equity	10.03.2017	EUR 42.267,20	Neg. Var. CABK SM Equity + LIBOR -1.757,99
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. CELG US Equity	08.02.2017	USD 622.038,34	Neg. Var. CELG US Equity + LIBOR -18.856,44
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. CELG US Equity	24.02.2017	USD 669.487,20	Neg. Var. CELG US Equity + LIBOR -11.737,66
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. CELG US Equity	17.02.2017	USD 316.839,96	Neg. Var. CELG US Equity + LIBOR -15.220,55
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. CELG US Equity	01.02.2017	USD 1.465.486,17	Neg. Var. CELG US Equity + LIBOR -7.518,29
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. CNHI IM Equity	24.03.2017	EUR 2.209.264,95	Neg. Var. CNHI IM Equity + LIBOR -5.220,92
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. DRI US Equity	20.03.2017	USD 279.397,89	Neg. Var. DRI US Equity + LIBOR -21.566,41
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. DRI US Equity	01.02.2017	USD 1.271.818,34	Neg. Var. DRI US Equity + LIBOR -84.235,60
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. DRI US Equity	08.02.2017	USD 365.495,95	Neg. Var. DRI US Equity + LIBOR -19.148,18
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. DSY FP Equity	21.04.2017	EUR 1.739.483,76	Neg. Var. DSY FP Equity + LIBOR -85.491,90
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. EDP PL Equity	13.03.2017	EUR 365.216,92	Neg. Var. EDP PL Equity + LIBOR 10.915,32
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. EDP PL Equity	02.02.2017	EUR 1.415.084,24	Neg. Var. EDP PL Equity + LIBOR 1.338,04
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. EDP PL Equity	24.03.2017	EUR 315.150,26	Neg. Var. EDP PL Equity + LIBOR 9.418,96
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. ELI1V FH Equity	21.04.2017	EUR 1.754.102,07	Neg. Var. ELI1V FH Equity + LIBOR -156.821,35
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. FRE GY Equity	03.04.2017	EUR 1.648.942,74	Neg. Var. FRE GY Equity + LIBOR -149.255,89
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. FUM1V FH Equity	10.03.2017	EUR 2.117.386,22	Neg. Var. FUM1V FH Equity + LIBOR -120.651,64
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. G IM Equity	31.03.2017	EUR 2.160.850,32	Neg. Var. G IM Equity + LIBOR -79.045,55
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. HEXAB SS Equity	21.04.2017	SEK 18.014.356,50	Neg. Var. HEXAB SS Equity + LIBOR -115.024,10
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. HVN AU Equity	03.02.2017	AUD 618.816,10	Neg. Var. HVN AU Equity + LIBOR 13.771,26
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. HVN AU Equity	09.03.2017	AUD 792.518,70	Neg. Var. HVN AU Equity + LIBOR 17.636,87
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. IBM US Equity	04.04.2017	USD 1.537.642,06	Neg. Var. IBM US Equity + LIBOR -91.031,93
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				

Technische Daten und Erläuterungen

Swapkontrakte

Art	Verbindlichkeiten		Fälligkeit		Forderungen		Bewertung
Gegenpartei	Nennwert				Nennwert		(in USD)
TRS	Pos. Var. IBM US Equity	01.03.2017	USD	329.617,63	Neg. Var. IBM US Equity + LIBOR		-22.372,26
BNP Paribas Paris - Paris - France							
TRS	Pos. Var. IBM US Equity	28.03.2017	USD	284.286,31	Neg. Var. IBM US Equity + LIBOR		-15.576,17
BNP Paribas Paris - Paris - France							
TRS	Pos. Var. JD US Equity	09.02.2017	USD	890.550,87	Neg. Var. JD US Equity + LIBOR		-44.802,37
BNP Paribas Paris - Paris - France							
TRS	Pos. Var. JD US Equity	04.04.2017	USD	307.568,45	Neg. Var. JD US Equity + LIBOR		2.967,63
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom							
TRS	Pos. Var. JD US Equity	01.02.2017	USD	758.927,61	Neg. Var. JD US Equity + LIBOR		20.489,11
BNP Paribas Paris - Paris - France							
TRS	Pos. Var. LUX IM Equity	17.04.2017	EUR	2.095.014,96	Neg. Var. LUX IM Equity + LIBOR		-13.561,49
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom							
TRS	Pos. Var. MDT US Equity	02.03.2017	USD	504.904,05	Neg. Var. MDT US Equity + LIBOR		-7.155,31
BNP Paribas Paris - Paris - France							
TRS	Pos. Var. MDT US Equity	24.02.2017	USD	625.180,56	Neg. Var. MDT US Equity + LIBOR		3.564,49
BNP Paribas Paris - Paris - France							
TRS	Pos. Var. MDT US Equity	01.02.2017	USD	655.748,40	Neg. Var. MDT US Equity + LIBOR		-9.266,61
BNP Paribas Paris - Paris - France							
TRS	Pos. Var. MDT US Equity	08.02.2017	USD	547.609,61	Neg. Var. MDT US Equity + LIBOR		-992,88
BNP Paribas Paris - Paris - France							
TRS	Pos. Var. MEO GY Equity	03.04.2017	EUR	2.175.877,95	Neg. Var. MEO GY Equity + LIBOR		-196.304,40
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom							
TRS	Pos. Var. MSI US Equity	27.02.2017	USD	379.826,20	Neg. Var. MSI US Equity + LIBOR		717,00
BNP Paribas Paris - Paris - France							
TRS	Pos. Var. MSI US Equity	21.03.2017	USD	584.354,88	Neg. Var. MSI US Equity + LIBOR		-4.150,57
BNP Paribas Paris - Paris - France							
TRS	Pos. Var. MSI US Equity	09.02.2017	USD	372.159,10	Neg. Var. MSI US Equity + LIBOR		8.165,41
BNP Paribas Paris - Paris - France							
TRS	Pos. Var. MSI US Equity	01.02.2017	USD	690.004,00	Neg. Var. MSI US Equity + LIBOR		61.177,12
BNP Paribas Paris - Paris - France							
TRS	Pos. Var. NOVOB DC Equity	03.02.2017	DKK	8.816.108,00	Neg. Var. NOVOB DC Equity + LIBOR		-51.380,88
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom							
TRS	Pos. Var. NOVOB DC Equity	04.04.2017	DKK	3.228.681,00	Neg. Var. NOVOB DC Equity + LIBOR		-31.164,80
BNP Paribas Paris - Paris - France							
TRS	Pos. Var. NOVOB DC Equity	24.03.2017	DKK	2.313.754,00	Neg. Var. NOVOB DC Equity + LIBOR		-13.484,72
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom							
TRS	Pos. Var. NOVOB DC Equity	08.03.2017	DKK	3.227.012,00	Neg. Var. NOVOB DC Equity + LIBOR		-18.807,25
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom							
TRS	Pos. Var. NOVOB DC Equity	03.04.2017	DKK	2.307.668,00	Neg. Var. NOVOB DC Equity + LIBOR		-13.449,25
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom							
TRS	Pos. Var. NOVOB DC Equity	09.03.2017	DKK	2.081.770,00	Neg. Var. NOVOB DC Equity + LIBOR		-12.132,70
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom							
TRS	Pos. Var. NOVOB DC Equity	06.03.2017	DKK	3.448.614,00	Neg. Var. NOVOB DC Equity + LIBOR		-20.098,76
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom							

Technische Daten und Erläuterungen

Swapkontrakte

Art	Verbindlichkeiten	Fälligkeit	Forderungen	Bewertung
Gegenpartei	Nennwert		Nennwert	(in USD)
TRS	Pos. Var. PAYX US Equity	08.02.2017 USD	259.638,06 Neg. Var. PAYX US Equity + LIBOR	-11.122,55
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. PAYX US Equity	23.03.2017 USD	439.135,97 Neg. Var. PAYX US Equity + LIBOR	-21.128,24
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. PAYX US Equity	01.02.2017 USD	1.143.681,80 Neg. Var. PAYX US Equity + LIBOR	-44.230,65
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. PSM GY Equity	21.04.2017 EUR	1.904.033,32 Neg. Var. PSM GY Equity + LIBOR	-56.754,30
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. QCOM US Equity	23.03.2017 USD	329.414,40 Neg. Var. QCOM US Equity + LIBOR	-7.714,57
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. ROG VX Equity	17.03.2017 CHF	294.497,80 Neg. Var. ROG VX Equity + LIBOR	-34.153,21
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. ROG VX Equity	02.02.2017 CHF	1.676.044,50 Neg. Var. ROG VX Equity + LIBOR	-144.542,04
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. ROG VX Equity	13.03.2017 CHF	995.393,20 Neg. Var. ROG VX Equity + LIBOR	-115.436,76
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. ROG VX Equity	24.03.2017 CHF	813.965,70 Neg. Var. ROG VX Equity + LIBOR	-94.396,42
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. ROG VX Equity	24.04.2017 CHF	271.321,90 Neg. Var. ROG VX Equity + LIBOR	-31.465,48
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. SAND SS Equity	17.04.2017 SEK	19.137.757,10 Neg. Var. SAND SS Equity + LIBOR	-62.142,80
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. TMO US Equity	08.02.2017 USD	439.430,80 Neg. Var. TMO US Equity + LIBOR	-12.819,99
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. TMO US Equity	24.02.2017 USD	441.191,04 Neg. Var. TMO US Equity + LIBOR	-3.183,44
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. TMO US Equity	01.02.2017 USD	1.117.209,00 Neg. Var. TMO US Equity + LIBOR	-40.066,85
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. VZ US Equity	22.03.2017 USD	571.449,06 Neg. Var. VZ US Equity + LIBOR	-20.454,85
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. VZ US Equity	13.02.2017 USD	1.147.141,05 Neg. Var. VZ US Equity + LIBOR	5.660,70
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. WDAY US Equity	22.03.2017 USD	840.248,25 Neg. Var. WDAY US Equity + LIBOR	-7.245,82
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. WDAY US Equity	21.03.2017 USD	903.783,80 Neg. Var. WDAY US Equity + LIBOR	-7.793,72
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. WDAY US Equity	16.03.2017 USD	88.122,97 Neg. Var. WDAY US Equity + LIBOR	-4.171,14
BNP Paribas Paris - Paris - France				
TRS	Pos. Var. WTB LN Equity	10.04.2017 GBP	1.628.379,00 Neg. Var. WTB LN Equity + LIBOR	-277.935,09
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. 322 HK Equity	03.02.2017 HKD	2.165.040,00 Neg. Var. 322 HK Equity + LIBOR	53.270,40
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				
TRS	Pos. Var. 322 HK Equity	13.03.2017 HKD	1.099.980,00 Neg. Var. 322 HK Equity + LIBOR	27.064,80
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom				

Swapkontrakte									
Art			Verbindlichkeiten		Fälligkeit		Forderungen		Bewertung
Gegenpartei		Nennwert					Nennwert	(in USD)	
TRS		Pos. Var. 3988 HK Equity	03.02.2017	HKD	2.514.330,00	Neg. Var. 3988 HK Equity + LIBOR		-9.541,06	
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom									
TRS		Pos. Var. 489 HK Equity	03.04.2017	HKD	2.082.800,00	Neg. Var. 489 HK Equity + LIBOR		-15.084,27	
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom									
TRS		Pos. Var. 489 HK Equity	03.02.2017	HKD	4.395.200,00	Neg. Var. 489 HK Equity + LIBOR		-31.831,38	
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom									
TRS		Pos. Var. 6030 HK Equity	03.02.2017	HKD	2.822.000,00	Neg. Var. 6030 HK Equity + LIBOR		-5.310,90	
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom									
TRS	GBP	1.404.831,19	Neg. Perf. BATS LN Equity + ICE LIBOR GBP 1 Month + 30 Bps	26.05.2017		Pos. Perf. BATS LN Equity - (ICE LIBOR GBP 1 Month + 30 Bps)		6.777,34	
BNP Paribas Paris - Paris - France									
TRS	EUR	659.049,98	Neg. Perf. DRI GY Equity + (ICE LIBOR EUR 1M + 50 Bps)	18.05.2017		Pos. Perf. DRI GY Equity - (ICE LIBOR EUR 1M - 50 Bps)		-12.024,71	
BNP Paribas Paris - Paris - France									
TRS	EUR	1.794.254,78	Neg. Perf. DRI GY Equity + (ICE LIBOR EUR 1M + 50 Bps)	19.05.2017		Pos. Perf. DRI GY Equity - (ICE LIBOR EUR 1M - 50 Bps)		-43.383,91	
BNP Paribas Paris - Paris - France									
TRS	GBP	624.343,14	Neg. Perf. GSK LN Equity + (BP0001M + 45.0000000000 Bps)	05.04.2017		Pos. Perf. GSK LN Equity - (BP0001M + 45.0000000000 Bps)		8.459,45	
BNP Paribas Paris - Paris - France									
TRS	GBP	397.277,45	Neg. Perf. GSK LN Equity + ICE LIBOR GBP 1 Month + 30 Bps	05.05.2017		Pos. Perf. GSK LN Equity - (ICE LIBOR GBP 1 Month + 30 Bps)		5.042,86	
BNP Paribas Paris - Paris - France									
TRS	GBP	2.058.279,81	Neg. Perf. ITRK LN Equity + ICE LIBOR GBP 1 Month + 40 Bps	12.06.2017		Pos. Perf. ITRK LN Equity - (ICE LIBOR GBP 1 Month + 40 Bps)		-144.462,30	
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom									
TRS	EUR	312.105,99	Neg. Perf. PHIA NA Equity + ICE LIBOR EUR 1M + 30 Bps	01.05.2017		Pos. Perf. PHIA NA Equity - (ICE LIBOR EUR 1M + 30 Bps)		12.894,53	
BNP Paribas Paris - Paris - France									
TRS	EUR	1.633.226,93	Neg. Perf. PHIA NA Equity + ICE LIBOR EUR 1M + 40 Bps	29.05.2017		Pos. Perf. PHIA NA Equity - (ICE LIBOR EUR 1M + 40 Bps)		137.803,42	
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom									
TRS	EUR	2.743.330,15	Neg. Perf. RACE IM Equity + ICE LIBOR EUR 1M + 40 Bps	29.05.2017		Pos. Perf. RACE IM Equity - (ICE LIBOR EUR 1M + 40 Bps)		51.614,34	
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom									
TRS	EUR	585.849,10	Neg. Perf. SAN FP Equity + (EUR001M + 25 Bps)	05.04.2017		Pos. Perf. SAN FP Equity - (EUR001M + 25 Bps)		46.160,07	
BNP Paribas Paris - Paris - France									
TRS	EUR	326.811,87	Neg. Perf. SAP GY Equity + (EUR001M + 25 Bps)	06.04.2017		Pos. Perf. SAP GY Equity - (EUR001M + 25 Bps)		34.786,30	
BNP Paribas Paris - Paris - France									
TRS	EUR	551.688,75	Neg. Perf. SAP GY Equity + ICE LIBOR EUR 1M + 25 Bps	24.04.2017		Pos. Perf. SAP GY Equity - (ICE LIBOR EUR 1M + 25 Bps)		22.103,78	
BNP Paribas Paris - Paris - France									

Art		Verbindlichkeiten		Fälligkeit	Forderungen	Bewertung
Gegenpartei		Nennwert			Nennwert	(in USD)
TRS	SEK	23.658.273,35	Neg. Perf. SCAB SS Equity + STIBOR Interbank Offered Rate + 45 Bps <i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>	12.06.2017	Pos. Perf. SCAB SS Equity - (STIBOR Interbank Offered Rate + 45 Bps)	151.573,40
TRS	EUR	2.576.352,00	Neg. Perf. SIE GR Equity + ICE LIBOR EUR 1M + 25 Bps <i>BNP Paribas Paris - Paris - France</i>	20.04.2017	Pos. Perf. SIE GR Equity - (ICE LIBOR EUR 1M + 25 Bps)	85.218,50
TRS	EUR	2.585.935,44	Neg. Perf. UTDI GY Equity + ICE LIBOR EUR 1M + 40 Bps <i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>	27.06.2017	Pos. Perf. UTDI GY Equity - (ICE LIBOR EUR 1M + 40 Bps)	-13.154,43
TRS	USD	296.946,30	Neg. Perf. 028150 KS Equity + ICE LIBOR USD 1 Month + 80 Bps <i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>	19.05.2017	Pos. Perf. 028150 KS Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month + 80 Bps)	-15.111,17
TRS	USD	978.049,41	Neg. Perf. 086280 KS Equity + ICE LIBOR USD 1 Month + 80 Bps <i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>	22.05.2017	Pos. Perf. 086280 KS Equity - (ICE LIBOR USD 1 Month + 80 Bps)	-35.040,79
TRS	HKD	2.953.170,00	Neg. Perf. 493 HK Equity + HK Assoc of Banks Hong Kong Do + 55 Bps <i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>	26.05.2017	Pos. Perf. 493 HK Equity - (HK Assoc of Banks Hong Kong Do + 55 Bps)	-23.253,53
TRS	HKD	1.166.880,00	Neg. Perf. 636 HK Equity + HK Assoc of Banks Hong Kong Do + 55 Bps <i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>	15.05.2017	Pos. Perf. 636 HK Equity - (HK Assoc of Banks Hong Kong Do + 55 Bps)	13.713,84
TRS	HKD	8.671.120,00	Neg. Perf. 700 HK Equity + (HIHD01M + 55 Bps) <i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>	05.05.2017	Pos. Perf. 700 HK Equity - (HIHD01M + 55 Bps)	148.908,71
TRS	HKD	3.782.160,00	Neg. Perf. 819 HK Equity + HK Assoc of Banks Hong Kong Do + 55 Bps <i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>	08.05.2017	Pos. Perf. 819 HK Equity - (HK Assoc of Banks Hong Kong Do + 55 Bps)	-13.177,78
TRS	EUR	2.586.326,80	Neg. Var. ATL IM Equity + LIBOR <i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>	17.04.2017	Pos. Var. ATL IM Equity	29.164,19
TRS	EUR	2.562.624,88	Neg. Var. DG FP Equity + LIBOR <i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>	17.04.2017	Pos. Var. DG FP Equity	145.404,19
TRS	EUR	57.700,72	Neg. Var. FGR FP Equity + LIBOR <i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>	09.03.2017	Pos. Var. FGR FP Equity	-1.347,07
TRS	EUR	1.265.119,30	Neg. Var. FGR FP Equity + LIBOR <i>BNP Paribas Paris - Paris - France</i>	02.02.2017	Pos. Var. FGR FP Equity	-32.647,33
TRS	EUR	731.888,08	Neg. Var. FGR FP Equity + LIBOR <i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>	18.04.2017	Pos. Var. FGR FP Equity	-17.086,42
TRS	EUR	527.243,78	Neg. Var. FGR FP Equity + LIBOR <i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>	24.03.2017	Pos. Var. FGR FP Equity	-12.308,86
TRS	GBP	221.309,66	Neg. Var. GSK LN Equity + LIBOR <i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>	09.03.2017	Pos. Var. GSK LN Equity	3.010,24
TRS	GBP	178.810,32	Neg. Var. GSK LN Equity + LIBOR <i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>	17.03.2017	Pos. Var. GSK LN Equity	2.432,16

Art	Verbindlichkeiten			Fälligkeit	Forderungen	Bewertung
Gegenpartei	Nennwert				Nennwert	(in USD)
TRS	GBP	1.052.137,22	Neg. Var. GSK LN Equity + LIBOR	02.02.2017	Pos. Var. GSK LN Equity	-8.885,91
BNP Paribas Paris - Paris - France						
TRS	GBP	415.064,33	Neg. Var. GSK LN Equity + LIBOR	08.03.2017	Pos. Var. GSK LN Equity	5.645,68
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom						
TRS	GBP	203.437,33	Neg. Var. GSK LN Equity + LIBOR	24.04.2017	Pos. Var. GSK LN Equity	2.767,14
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom						
TRS	GBP	559.130,13	Neg. Var. GSK LN Equity + LIBOR	24.03.2017	Pos. Var. GSK LN Equity	7.605,25
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom						
TRS	GBP	1.998.026,40	Neg. Var. IMB LN Equity + LIBOR	03.04.2017	Pos. Var. IMB LN Equity	17.034,84
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom						
TRS	EUR	1.588.910,40	Neg. Var. SAN FP Equity + LIBOR	02.02.2017	Pos. Var. SAN FP Equity	111.776,65
BNP Paribas Paris - Paris - France						
TRS	EUR	25.898,60	Neg. Var. SAN FP Equity + LIBOR	24.03.2017	Pos. Var. SAN FP Equity	2.037,47
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom						
TRS	EUR	1.701.338,80	Neg. Var. SAN FP Equity + LIBOR	17.04.2017	Pos. Var. SAN FP Equity	133.846,23
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom						
TRS	EUR	279.846,84	Neg. Var. SAP GY Equity + LIBOR	02.02.2017	Pos. Var. SAP GY Equity	26.640,57
BNP Paribas Paris - Paris - France						
TRS	EUR	318.639,70	Neg. Var. SAP GY Equity + LIBOR	13.03.2017	Pos. Var. SAP GY Equity	33.358,01
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom						
TRS	EUR	248.491,66	Neg. Var. SAP GY Equity + LIBOR	09.03.2017	Pos. Var. SAP GY Equity	26.014,30
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom						
TRS	EUR	525.312,48	Neg. Var. SAP GY Equity + LIBOR	31.03.2017	Pos. Var. SAP GY Equity	46.990,46
BNP Paribas Paris - Paris - France						
TRS	EUR	2.513.438,03	Neg. Var. WKL NA Equity + LIBOR	17.04.2017	Pos. Var. WKL NA Equity	218.864,96
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom						
TRS	USD	2.615.159,55	Neg. Var. 005930 KS Equity + LIBOR	21.04.2017	Pos. Var. 005930 KS Equity	-72.816,23
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom						
TRS	USD	385.532,68	Neg. Var. 005930 KS Equity + LIBOR	01.05.2017	Pos. Var. 005930 KS Equity	-10.734,73
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom						
TRS	HKD	1.685.400,00	Neg. Var. 152 HK Equity + LIBOR	06.03.2017	Pos. Var. 152 HK Equity	-8.138,41
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom						
TRS	HKD	2.594.880,00	Neg. Var. 152 HK Equity + LIBOR	06.03.2017	Pos. Var. 152 HK Equity	-12.530,08
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom						
TRS	HKD	2.671.200,00	Neg. Var. 152 HK Equity + LIBOR	13.03.2017	Pos. Var. 152 HK Equity	-12.898,62
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom						
TRS	HKD	4.722.300,00	Neg. Var. 493 HK Equity + LIBOR	01.05.2017	Pos. Var. 493 HK Equity	-37.183,82
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom						
TRS	HKD	2.525.490,00	Neg. Var. 493 HK Equity + LIBOR	10.04.2017	Pos. Var. 493 HK Equity	-19.885,94
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom						
TRS	HKD	855.360,00	Neg. Var. 493 HK Equity + LIBOR	06.03.2017	Pos. Var. 493 HK Equity	-6.735,18
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom						
TRS	HKD	4.443.120,00	Neg. Var. 493 HK Equity + LIBOR	17.04.2017	Pos. Var. 493 HK Equity	-34.985,53
JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom						

Art		Verbindlichkeiten		Fälligkeit	Forderungen	Bewertung
Gegenpartei		Nennwert			Nennwert	(in USD)
TRS	HKD	2.862.090,00	Neg. Var. 493 HK Equity + LIBOR	13.03.2017	Pos. Var. 493 HK Equity	-22.536,36
<i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>						
TRS	HKD	3.039.300,00	Neg. Var. 493 HK Equity + LIBOR	13.03.2017	Pos. Var. 493 HK Equity	-23.931,72
<i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>						
TRS	HKD	2.466.520,00	Neg. Var. 700 HK Equity + LIBOR	27.03.2017	Pos. Var. 700 HK Equity	42.357,42
<i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>						
TRS	HKD	10.019.280,00	Neg. Var. 700 HK Equity + LIBOR	03.02.2017	Pos. Var. 700 HK Equity	172.060,59
<i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>						
TRS	HKD	3.401.040,00	Neg. Var. 700 HK Equity + LIBOR	13.03.2017	Pos. Var. 700 HK Equity	58.405,89
<i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>						
TRS	HKD	2.466.520,00	Neg. Var. 700 HK Equity + LIBOR	13.03.2017	Pos. Var. 700 HK Equity	42.357,42
<i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>						
TRS	HKD	2.261.880,00	Neg. Var. 819 HK Equity + LIBOR	03.02.2017	Pos. Var. 819 HK Equity	-7.880,83
<i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>						
TRS	HKD	2.298.960,00	Neg. Var. 819 HK Equity + LIBOR	13.03.2017	Pos. Var. 819 HK Equity	-8.010,02
<i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>						
TRS	HKD	4.017.000,00	Neg. Var. 819 HK Equity + LIBOR	06.03.2017	Pos. Var. 819 HK Equity	-13.996,01
<i>JP Morgan Chase Bank London - London - United Kingdom</i>						
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Swapkontrakten						-2.480.288,00

Nettovermögensaufstellung in USD und Fondsentwicklung

	31.05.2016
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	155.987.549,05
Bankguthaben und sonstige	18.742.505,11
Forderungen aus Zeichnungen	40.684,43
Forderungen aus Erträgen	82.277,16
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Finanzterminkontrakten	56.940,20
	174.909.955,95
Passiva	
Bankverbindlichkeiten und sonstige	145.051,48
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	431.594,13
Rückstellungen für Aufwendungen	360.066,48
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Swapkontrakten	2.480.288,06
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	768.311,43
Andere Passiva	464,30
	4.185.775,88
Nettovermögen	170.724.180,07

USD 4.160.937,92 wurden als Barsicherheiten im Rahmen von Swapgeschäften mit BNP Paribas Paris hinterlegt.
 USD 10.445.310,00 wurden als Barsicherheiten im Rahmen von Swapgeschäften mit JP Morgan Chase Bank London hinterlegt.
 Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Nettovermögensaufstellung in USD und Fondsentwicklung

Fondsentwicklung		31.05.2016
Fondsvermögen	USD	170.724.180,07
Nettoinventarwert pro Aktie		
B -Thesaurierend	USD	97,55
EB -Thesaurierend	USD	977,32
FB -Thesaurierend	USD	978,29
IB -Thesaurierend	USD	977,09
UB -Thesaurierend	USD	97,63
EBH -Thesaurierend	CHF	972,25
FBH -Thesaurierend	CHF	973,22
UBH -Thesaurierend	CHF	97,12
EBH -Thesaurierend	EUR	974,51
FBH -Thesaurierend	EUR	975,42
IBH -Thesaurierend	EUR	974,23
UBH -Thesaurierend	EUR	97,35
FBH -Thesaurierend	GBP	978,20
UBH -Thesaurierend	GBP	97,62

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Periode	zu Beginn der Periode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
B -Thesaurierend	USD	5.712,000	0,000	5.712,000	0,000
EB -Thesaurierend	USD	10,000	0,000	10,000	0,000
FB -Thesaurierend	USD	31.378,124	0,000	35.305,860	3.927,736
IB -Thesaurierend	USD	1.458,000	0,000	1.458,000	0,000
UB -Thesaurierend	USD	202,661	0,000	202,661	0,000
EBH -Thesaurierend	CHF	10,000	0,000	10,000	0,000
FBH -Thesaurierend	CHF	81.355,770	0,000	88.447,301	7.091,531
UBH -Thesaurierend	CHF	900,000	0,000	900,000	0,000
EBH -Thesaurierend	EUR	10,000	0,000	10,000	0,000
FBH -Thesaurierend	EUR	47.379,178	0,000	55.104,998	7.725,820
IBH -Thesaurierend	EUR	10,000	0,000	10,000	0,000
UBH -Thesaurierend	EUR	100,000	0,000	100,000	0,000
FBH -Thesaurierend	GBP	4.765,373	0,000	5.187,441	422,068
UBH -Thesaurierend	GBP	100,000	0,000	100,000	0,000

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens in USD

Für die Periode vom
29.01.2016 bis zum
31.05.2016

Nettovermögen zu Beginn der Periode	0,00
Erträge	
Dividenden (Netto)	426.039,00
Bankzinsen	8.068,16
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	970,12
	435.077,28
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	399.633,82
Unter-Anlageverwaltergebühr	468.457,23
Depotbank- und Depotgebühr	22.718,02
Verwaltungskosten	56.813,71
Druck- und Veröffentlichungskosten	10.229,33
Zinsen und Bankspesen	873,83
Kosten für Revision, Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	30.744,12
"Taxe d'abonnement"	7.702,93
	997.172,99
Nettoerträge (-verluste)	-562.095,71
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	5.615.767,28
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	496.231,78
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	-11.136.103,12
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	2.671.043,46
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-11.714,96
	-2.364.775,56
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-2.926.871,27
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	5.426.053,57
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Finanzterminkontrakten	56.940,20
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-2.480.288,06
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-768.311,43
	2.234.394,28
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	-692.476,99
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	191.498.495,44
Rücknahmen	-20.081.838,38
	171.416.657,06
Nettovermögen am Ende der Periode	170.724.180,07

Geographische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestandes Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Geographische Aufteilung

USA	80,97
Irland	5,62
Taiwan	1,64
Niederlande	1,38
Vereinigtes Königreich	1,01
Bermudas	0,75
Total	91,37

Wirtschaftliche Aufteilung

Länder und Zentralregierungen	39,23
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	15,20
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	11,26
Elektrische Geräte und Komponenten	5,59
Elektronik und Halbleiter	5,06
Energie- und Wasserversorgung	3,63
Computer und Netzwerkausrüster	2,45
Einzelhandel und Warenhäuser	1,72
Holding- und Finanzgesellschaften	1,64
Verkehr und Transport	1,42
Chemie	1,21
Nahrungsmittel und Softdrinks	1,18
Banken und andere Kreditinstitute	1,13
Maschinen und Apparate	0,45
Telekommunikation	0,20
Total	91,37

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Netto- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere: Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)			
Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)			
USD AIR PRODUCTS & CHEMICALS	14.423,00	2.057.296,72	1,21
USD ALLERGAN	13.880,00	3.272.210,00	1,92
USD ALPHABET -A-	5.321,00	3.984.630,85	2,33
USD AMAZON.COM	4.053,00	2.929.467,87	1,72
USD BANK OF AMERICA	130.618,00	1.931.840,22	1,13
USD BAXTER INTERNATIONAL	72.284,00	3.119.777,44	1,83
USD BLACK HILLS	40.590,00	2.457.318,60	1,44
USD BOSTON SCIENTIFIC	120.092,00	2.727.289,32	1,60
USD BRISTOL MYERS SQUIBB	27.518,00	1.973.040,60	1,16
USD CF INDUSTRIES HOLDINGS	101.054,00	2.795.153,64	1,64
USD CISCO SYSTEMS	69.882,00	2.030.072,10	1,19
USD DANAHER	7.801,00	767.306,36	0,45
USD ELI LILLY & CO	72.397,00	5.431.946,91	3,18
USD FACEBOOK -A-	24.985,00	2.968.467,85	1,74
USD GENERAL ELECTRIC	106.932,00	3.232.554,36	1,89
USD MARVELL TECHNOLOGY GROUP	124.671,00	1.275.384,33	0,75
USD MERCK & CO	41.232,00	2.319.712,32	1,36
USD MICRON TECHNOLOGY	172.528,00	2.194.556,16	1,29
USD MICROSOFT	102.092,00	5.410.876,00	3,17
USD MONDELEZ INTERNATIONAL	45.147,00	2.008.590,03	1,18
USD NORFOLK SOUTHERN	28.930,00	2.431.855,80	1,42
USD NXP SEMICONDUCTORS	24.923,00	2.354.974,27	1,38
USD PFIZER	33.362,00	1.157.661,40	0,68
USD QUALCOMM	6.174,00	339.076,08	0,20
USD SEMPRA ENERGY	34.895,00	3.737.952,40	2,19
USD SHIRE ADR	9.274,00	1.726.447,84	1,01
USD ST JUDE MEDICAL	27.131,00	2.125.985,16	1,25
USD TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING ADR	113.331,00	2.801.542,32	1,64
USD THE PRICELINE GROUP	1.486,00	1.878.794,38	1,10
USD TYCO INTERNATIONAL	148.736,00	6.339.128,32	3,70
USD VERTEC PHARMACEUTICALS	22.258,00	2.073.332,70	1,21
USD VMWARE	33.009,00	1.999.025,04	1,17
USD WESTERN DIGITAL	46.403,00	2.159.595,62	1,26
USD YAHOO	78.838,00	2.991.113,72	1,75
Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)		89.003.976,73	52,14
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere: Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)			
		89.003.976,73	52,14
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere: Anleihen			
Anleihen			
USD US 04.08.2016	10.000.000,00	9.996.343,80	5,86
USD US 07.07.2016	3.000.000,00	2.999.358,62	1,76
USD US 09.06.2016	14.000.000,00	13.998.915,01	8,19
USD US 11.08.2016	6.000.000,00	5.997.060,00	3,51
USD US 16-28.07.2016	9.000.000,00	8.996.447,46	5,27
USD US 23.06.2016	14.000.000,00	13.997.339,02	8,20
USD US 30.06.2016	11.000.000,00	10.998.108,41	6,44
Anleihen		66.983.572,32	39,23
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere: Anleihen			
		66.983.572,32	39,23
Total des Wertpapierbestandes		155.987.549,05	91,37
Bankguthaben und sonstige		18.742.505,11	10,98
Bankverbindlichkeiten und sonstige		-145.051,48	-0,08
Andere Passiva		-3.860.822,61	-2,27
Fondsvermögen		170.724.180,07	100,00

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.
Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Technische Daten und Erläuterungen**Technische Daten**

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B -Thesaurierend	USD	20197562	LU0863552302	1,30%	2,53%
EB -Thesaurierend	USD	20113854	LU0861833076	0,50%	1,71%
UB -Thesaurierend	USD	26364580	LU1144420111	1,00%	2,41%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2015	2014	2013
B -Thesaurierend	USD	1,09%	-17,37%	-10,51%	/	/
EB -Thesaurierend	USD	1,43%	/	-9,87%	-2,78%	0,07%
UB -Thesaurierend	USD	1,20%	-12,46%	/	/	/

Nettovermögensaufstellung in USD und Fondsentwicklung

	31.05.2016
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	281.837.643,31
Bankguthaben und sonstige	435.348,71
Forderungen aus Erträgen	28.974,08
	282.301.966,10
Passiva	
Rückstellungen für Aufwendungen	154.028,41
	154.028,41
Nettovermögen	282.147.937,69

Fondsentwicklung		31.05.2016	30.11.2015	30.11.2014
Fondsvermögen	USD	282.147.937,69	297.034.789,89	152.009.060,30
Nettoinventarwert pro Aktie				
B -Thesaurierend	USD	82,63	83,87	95,44
EB -Thesaurierend	USD	89,86	90,83	102,72
UB -Thesaurierend	USD	87,54	88,73	/

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Periode	zu Beginn der Periode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
B -Thesaurierend	USD	1.524,834	801,000	973,834	250,000
EB -Thesaurierend	USD	3.116.061,178	3.267.735,496	234.415,523	386.089,841
UB -Thesaurierend	USD	21.310,749	98,798	21.211,951	0,000

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens in USD

Für die Periode vom
01.12.2015 bis zum
31.05.2016

Nettovermögen zu Beginn der Periode	297.034.789,89
Erträge	
Dividenden (Netto)	32.478,00
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	7.407,88
Andere Erträge	516.863,13
	556.749,01
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	683.102,58
Depotbank- und Depotgebühr	62.874,10
Verwaltungskosten	139.539,97
Druck- und Veröffentlichungskosten	13.278,71
Zinsen und Bankspesen	1.800,18
Kosten für Revision, Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	36.189,38
"Taxe d'abonnement"	1.709,14
	938.494,06
Nettoerträge (-verluste)	-381.745,05
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-15.662.876,85
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	97.085,20
	-15.565.791,65
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-15.947.536,70
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	12.400.748,95
	12.400.748,95
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	-3.546.787,75
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	22.170.620,51
Rücknahmen	-33.510.684,96
	-11.340.064,45
Nettovermögen am Ende der Periode	282.147.937,69

Geographische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestandes

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Geographische Aufteilung

Luxemburg	88,21
Irland	11,68
Total	99,89

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	99,89
Total	99,89

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Netto- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere: Investmentfonds			
Fondsanteile (Open-End)			
USD BLACKROCK GLOBAL FUNDS SICAV - ASIAN GROWTH LEADERS FUND (reg. -S-) -I2- USD	2.600.000,00	26.858.000,00	9,52
USD CREDIT SUISSE (LUX) RUSSIAN EQUITY FUND - EB-	80.000,00	5.268.000,00	1,87
USD FIDELITY ACTIVE STRATEGY SICAV - ASIA FUND -Y- ACC -USD-	250.000,00	29.472.500,00	10,45
USD FIDELITY ACTIVE STRATEGY SICAV - EMERGING MARKETS FUND -A-	173.000,00	21.277.270,00	7,54
USD FIDELITY FUNDS SICAV - TAIWAN FUND -Y- ACC-USD	1.100.000,00	11.055.000,00	3,92
USD FIDELITY FUNDS SICAV - EMERGING ASIA FUND -A-	2.300.000,00	29.831.000,00	10,57
USD FIDELITY FUNDS SICAV - EMERGING EUROPE MIDDLE EAST AND AFRICA FUND -A-	780.000,00	9.352.200,00	3,31
USD GOLDMAN SACHS FUNDS SICAV - GROWTH & EMERGING MARKETS BROAD EQUITY PORTFOLIO -I-	1.200.000,00	16.440.000,00	5,83
USD INVESCO KOREAN EQUITY FUND -A-	260.000,00	7.997.600,00	2,83
USD ISHARES MSCI AC FAR EAST EX-JAPAN UCITS ETF	154.000,00	6.250.937,00	2,22
USD ISHARES MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF	330.000,00	6.744.969,00	2,39
USD JP MORGAN FUNDS SICAV - LATIN AMERICA EQUITY FUND -A- USD	1.050.000,00	20.716.500,00	7,34
USD KIM INVESTMENT FUNDS SICAV - KIM KOREA NAVIGATOR FUND -I- USD	153.000,00	17.018.235,90	6,03
USD MELCHIOR SELECTED TRUST SICAV - MELCHIOR ASIAN OPPORTUNITIES FUND -I2- USD	247.000,00	20.549.856,60	7,28
USD NEUBERGER BERMAN -I- USD	700.000,00	11.963.000,00	4,24
USD RAM (LUX) SYSTEMATIC FUND SICAV - EMERGING MARKETS EQUITIES -BP-	141.000,00	20.277.210,58	7,19
EUR SCHRODER INTERNATIONAL SELECTION FUND SICAV - EMERGING EUROPE -A-	720.000,00	17.514.290,23	6,21
USD SCHRODER INTERNATIONAL SELECTION FUND SICAV - INDIAN EQUITY -C-	20.000,00	3.251.074,00	1,15
Fondsanteile (Open-End)		281.837.643,31	99,89
Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere: Investmentfonds		281.837.643,31	99,89
Total des Wertpapierbestandes		281.837.643,31	99,89
Bankguthaben und sonstige		435.348,71	0,15
Andere Passiva		-125.054,33	-0,04
Fondsvermögen		282.147.937,69	100,00

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Technische Daten und Erläuterungen**Technische Daten**

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B -Thesaurierend	USD	20197552	LU0863553888	0,95%	1,57%
EB -Thesaurierend	USD	20113857	LU0861833316	0,50%	1,18%
UB -Thesaurierend	USD	26364761	LU1144420202	0,70%	1,43%
EBH -Thesaurierend	CHF	20113914	LU0861833589	0,50%	1,18%
EBH -Thesaurierend	EUR	20113929	LU0861833662	0,50%	1,18%

Fondspersformance

		YTD	Seit Auflegung	2015	2014	2013
B -Thesaurierend	USD	4,49%	0,90%	-1,35%	/	/
EB -Thesaurierend	USD	4,67%	/	-1,13%	2,83%	-3,26%
UB -Thesaurierend	USD	4,58%	1,22%	/	/	/
EBH -Thesaurierend	CHF	3,93%	/	-2,30%	2,32%	-3,67%
EBH -Thesaurierend	EUR	4,18%	/	-1,86%	2,46%	-3,54%

Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung (in USD)
<i>Gegenpartei</i>					
EUR	221.007.956,15	USD	-246.422.987,08	15.06.2016	-289.078,41
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	238.756.284,80	USD	-243.264.461,82	15.06.2016	-2.972.496,60
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-3.261.575,01

Nettovermögensaufstellung in USD und Fondsentwicklung

	31.05.2016
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	554.033.834,00
Bankguthaben und sonstige	1.013.322,29
Forderungen aus Zeichnungen	734.071,53
Forderungen aus Erträgen	56.055,35
	555.837.283,17
Passiva	
Bankverbindlichkeiten und sonstige	74,09
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	1.136.626,12
Rückstellungen für Aufwendungen	307.021,07
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	3.261.575,01
Andere Passiva	116,04
	4.705.412,33
Nettovermögen	551.131.870,84

Fondsentwicklung		31.05.2016	30.11.2015	30.11.2014
Fondsvermögen	USD	551.131.870,84	580.777.741,78	478.894.661,36
Nettoinventarwert pro Aktie				
B -Thesaurierend	USD	100,90	97,99	99,20
EB -Thesaurierend	USD	103,01	99,84	100,86
UB -Thesaurierend	USD	101,22	98,21	/
EBH -Thesaurierend	CHF	100,04	97,80	99,96
EBH -Thesaurierend	EUR	101,03	98,49	100,23

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Periode	zu Beginn der Periode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
B -Thesaurierend	USD	240,600	240,600	0,000	0,000
EB -Thesaurierend	USD	638.902,403	758.225,975	34.765,819	154.089,391
UB -Thesaurierend	USD	4.173,798	98,798	4.075,000	0,000
EBH -Thesaurierend	CHF	2.364.748,423	2.166.176,317	586.799,608	388.227,502
EBH -Thesaurierend	EUR	2.192.894,736	2.871.318,778	321.786,646	1.000.210,688

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens in USD

Für die Periode vom
01.12.2015 bis zum
31.05.2016

Nettovermögen zu Beginn der Periode	580.777.741,78
Erträge	
Dividenden (Netto)	276.599,00
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	1.503,93
Andere Erträge	412.993,56
	691.096,49
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	1.127.486,59
Depotbank- und Depotgebühr	125.596,52
Verwaltungskosten	278.814,64
Druck- und Veröffentlichungskosten	26.584,13
Zinsen und Bankspesen	4.008,37
Kosten für Revision, Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	71.212,24
"Taxe d'abonnement"	4.930,03
	1.638.632,52
Nettoerträge (-verluste)	-947.536,03
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	564.015,59
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-15.499.630,99
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	2.997.693,28
	-11.937.922,12
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-12.885.458,15
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	17.345.970,89
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	31.785.433,49
	49.131.404,38
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	36.245.946,23
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	94.104.789,81
Rücknahmen	-159.996.606,98
	-65.891.817,17
Nettovermögen am Ende der Periode	551.131.870,84

Geographische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestandes Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Geographische Aufteilung

Luxemburg	80,04
Irland	16,82
Frankreich	3,67
Total	100,53

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	100,53
Total	100,53

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Netto- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere: Investmentfonds			
Fondsanteile (Open-End)			
USD AVIVA INVESTORS SICAV - GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND -A- USD	4.400.000,00	84.779.200,00	15,39
USD AXA FIIS US SHORT DURATION HIGH YIELD -A-	350.000,00	61.705.000,00	11,20
USD CREDIT SUISSE (LUX) GLOBAL INFLATION LINKED BOND FUND -EB- USD	330.000,00	46.665.300,00	8,47
USD CS FIXED INCOME SICAV-SIF GLOBAL HIGH YIELD -F-	100.000,00	18.099.000,00	3,28
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EB- USD	13.000,00	14.609.010,00	2,65
USD CS INVESTMENT FUNDS 3 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE INVESTMENT GRADE BOND FUND -EB- USD	18.000,00	19.810.980,00	3,59
USD DB X-TRACKERS II SICAV - DB X-TRACKERS II IBOMX GLOBAL INFLATION LINKED 2C	2.400.000,00	54.288.000,00	9,85
USD ISHARES II PLC - ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF	140.000,00	15.319.780,00	2,78
USD NEW CAPITAL UCITS WEALTHY NATIONS BOND FUND	200.000,00	22.842.000,00	4,14
USD NOMURA FUNDS IRELAND - US HIGH YIELD BOND FUND -I- USD	220.000,00	54.542.664,00	9,90
USD NORDEA 1 SICAV - EURO HIGH YIELD BD hbi	2.300.000,00	39.882.000,00	7,24
USD PICTET GLOBAL EMERGING DEBT -I-	60.000,00	22.554.600,00	4,09
USD UBAM FCP - EM INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND -IC- USD	160.000,00	20.235.200,00	3,67
USD UBAM SICAV - GLOBAL HIGH YIELD SOLUTION -AC-	300.000,00	44.637.000,00	8,10
USD VONTOBEL FUND SICAV -EMERGING MARKETS -I-	315.000,00	34.064.100,00	6,18
Fondsanteile (Open-End)		554.033.834,00	100,53
Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere: Investmentfonds			
		554.033.834,00	100,53
Total des Wertpapierbestandes		554.033.834,00	100,53
Bankguthaben und sonstige		1.013.322,29	0,18
Bankverbindlichkeiten und sonstige		-74,09	/
Andere Passiva		-3.915.211,36	-0,71
Fondsvermögen		551.131.870,84	100,00

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens in JPY

Für die Periode vom
01.12.2015 bis zum
10.12.2015

Nettovermögen zu Beginn der Periode	15.173.359.096,00
Erträge	
Andere Erträge	3.451.459,00
	3.451.459,00
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	3.715.027,00
Depotbank- und Depotgebühr	227.384,00
Verwaltungskosten	412.866,00
Druck- und Veröffentlichungskosten	4.024.358,00
Zinsen und Bankspesen	16.213,00
Kosten für Revision, Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	1.284.979,00
	9.680.827,00
Nettoerträge (-verluste)	-6.229.368,00
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	2.718.834.137,10
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-5.781.581,10
	2.713.052.556,00
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	2.706.823.188,00
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-3.132.308.875,00
	-3.132.308.875,00
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	-425.485.687,00
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	64.779.748,00
Rücknahmen	-14.812.653.157,00
	-14.747.873.409,00
Nettovermögen am Ende der Periode	0,00

Technische Daten und Erläuterungen**Technische Daten**

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B -Thesaurierend	EUR	13795107	LU0678256750	1,50%	3,60%
FB -Thesaurierend	EUR	13795109	LU0678257303	1,00%	3,10%
UB -Thesaurierend	EUR	25974711	LU1135115753	1,25%	3,38%
BH -Thesaurierend	CHF	13795114	LU0678258293	1,50%	3,61%
FBH -Thesaurierend	CHF	13795121	LU0678259853	1,00%	3,09%
IBH -Thesaurierend	CHF	13795117	LU0678258889	1,00%	3,13%
UBH -Thesaurierend	CHF	25974745	LU1135116215	1,25%	3,42%
FBH -Thesaurierend	GBP	13795122	LU0678260273	1,00%	3,09%
UBH -Thesaurierend	GBP	25974743	LU1135116058	1,25%	3,38%
BH -Thesaurierend	USD	13795116	LU0678258533	1,50%	3,61%
EBH -Thesaurierend	USD	26122112	LU1141893245	1,00%	3,11%
FBH -Thesaurierend	USD	13795123	LU0678260513	1,00%	3,09%
UBH -Thesaurierend	USD	25974748	LU1135116561	1,25%	3,63%

TER ohne performance fee ist: 3,58% für -B-; 3,10% für -FB- EUR; 3,36% für -UB- EUR; 3,60% für -BH- CHF; 3,09% für -FBH- CHF; 3,12% für -IBH- CHF; 3,40% für -UBH- CHF; 3,09% für -FBH- GBP; 3,36% für -UBH- GBP; 3,59% für -BH- USD; 3,09% für -FBH- USD; 3,63% für -UBH- USD.

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2015	2014	2013
B -Thesaurierend	EUR	-3,49%	/	-0,29%	0,42%	8,10%
FB -Thesaurierend	EUR	-3,29%	/	0,60%	1,05%	8,61%
UB -Thesaurierend	EUR	-3,39%	-4,16%	/	/	/
BH -Thesaurierend	CHF	-3,85%	/	-1,34%	-0,08%	7,87%
FBH -Thesaurierend	CHF	-3,64%	/	-0,47%	0,55%	8,18%
IBH -Thesaurierend	CHF	-3,64%	/	-0,72%	0,56%	8,72%
UBH -Thesaurierend	CHF	-3,74%	-5,60%	/	/	/
FBH -Thesaurierend	GBP	-3,26%	/	0,62%	1,08%	8,72%
UBH -Thesaurierend	GBP	-3,36%	-4,17%	/	/	/
BH -Thesaurierend	USD	-3,21%	/	-0,49%	/	/
EBH -Thesaurierend	USD	-3,01%	-9,06%	/	/	/
FBH -Thesaurierend	USD	-3,01%	/	0,65%	0,94%	8,53%
UBH -Thesaurierend	USD	-3,11%	-3,87%	/	/	/

Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
Gegenpartei					(in EUR)
CHF	127.909.994,17	EUR	-116.670.005,81	06.06.2016	-1.093.315,80
Credit Suisse Lux					
USD	83.568.869,09	EUR	-73.736.803,68	06.06.2016	1.318.538,01
Credit Suisse Lux					
GBP	10.398.463,03	EUR	-13.360.481,86	06.06.2016	232.831,11
Credit Suisse Lux					
EUR	975.741,15	USD	-1.123.000,00	06.06.2016	-32.859,22
Credit Suisse Lux					

Technische Daten und Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in EUR)
EUR	1.375.481,04	GBP	-1.088.000,00	06.06.2016	-46.806,09
<i>Credit Suisse Lux</i>					
EUR	23.644,72	USD	-27.000,00	06.06.2016	-604,77
<i>Credit Suisse Lux</i>					
EUR	962.631,89	USD	-1.081.000,00	06.06.2016	-8.243,22
<i>Credit Suisse Lux</i>					
EUR	53.251,45	CHF	-59.000,00	06.06.2016	-59,66
<i>Credit Suisse Lux</i>					
EUR	1.187.996,35	CHF	-1.314.000,00	06.06.2016	694,46
<i>Credit Suisse Lux</i>					
EUR	970.927,65	USD	-1.085.000,00	06.06.2016	-3.539,21
<i>Credit Suisse Lux</i>					
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften					366.635,61

Nettovermögensaufstellung in EUR und Fondsentwicklung

	31.05.2016
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	251.085.997,90
Bankguthaben und sonstige	3.766.680,94
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften	366.635,61
Andere Aktiva	10.492,95
	255.229.807,40
Passiva	
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	3.140.532,13
Rückstellungen für Aufwendungen	248.280,89
	3.388.813,02
Nettovermögen	251.840.994,38

Fondsentwicklung		31.05.2016	30.11.2015	30.11.2014
Fondsvermögen	EUR	251.840.994,38	419.425.509,42	369.283.710,32
Nettoinventarwert pro Aktie				
B -Thesaurierend	EUR	107,30	111,61	111,62
FB -Thesaurierend	EUR	1.088,97	1.129,82	1.119,96
UB -Thesaurierend	EUR	95,84	99,56	/
BH -Thesaurierend	CHF	104,42	109,15	110,19
FBH -Thesaurierend	CHF	1.057,25	1.102,27	1.103,06
IBH -Thesaurierend	CHF	1.053,14	1.098,09	1.101,71
UBH -Thesaurierend	CHF	94,40	98,55	/
FBH -Thesaurierend	GBP	1.093,28	1.133,33	1.123,43
UBH -Thesaurierend	GBP	95,83	99,47	/
BH -Thesaurierend	USD	98,77	102,38	102,64
EBH -Thesaurierend	USD	909,43	940,15	/
FBH -Thesaurierend	USD	1.092,36	1.129,26	1.119,48
UBH -Thesaurierend	USD	96,13	99,51	/

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Periode	zu Beginn der Periode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
B -Thesaurierend	EUR	4.562,056	7.034,510	0,000	2.472,454
FB -Thesaurierend	EUR	47.539,709	64.836,631	302,500	17.599,422
UB -Thesaurierend	EUR	98,857	98,857	0,000	0,000
BH -Thesaurierend	CHF	804,080	1.548,428	0,000	744,348
FBH -Thesaurierend	CHF	119.351,667	195.355,653	1.294,495	77.298,481
IBH -Thesaurierend	CHF	746,000	896,000	0,000	150,000
UBH -Thesaurierend	CHF	298,851	98,851	200,000	0,000
FBH -Thesaurierend	GBP	8.556,349	13.599,808	249,007	5.292,466
UBH -Thesaurierend	GBP	99,092	99,092	0,000	0,000
BH -Thesaurierend	USD	5.441,941	10.474,045	0,000	5.032,104
EBH -Thesaurierend	USD	1.260,000	1.260,000	0,000	0,000
FBH -Thesaurierend	USD	71.900,956	113.952,704	0,000	42.051,748
UBH -Thesaurierend	USD	5.165,325	98,701	5.066,624	0,000

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens in EUR

Für die Periode vom
01.12.2015 bis zum
31.05.2016

Nettovermögen zu Beginn der Periode	419.425.509,42
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	1.501.731,05
Depotbank- und Depotgebühr	59.904,26
Verwaltungskosten	134.865,93
Druck- und Veröffentlichungskosten	18.618,72
Zinsen und Bankspesen	15.336,30
Kosten für Revision, Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	46.650,72
"Taxe d'abonnement"	4.867,42
	1.781.974,40
Nettoerträge (-verluste)	-1.781.974,40
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-1.254.166,45
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-9.100.997,92
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-985.030,80
	-11.340.195,17
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-13.122.169,57
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-12.687.473,07
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-490.903,71
	-13.178.376,78
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	-26.300.546,35
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	2.388.653,13
Rücknahmen	-143.672.621,82
	-141.283.968,69
Nettovermögen am Ende der Periode	251.840.994,38

Geographische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestandes Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Geographische Aufteilung

Luxemburg	66,37
Irland	33,33
Total	99,70

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	99,70
Total	99,70

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Netto- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere: Investmentfonds			
Fondsanteile (Open-End)			
EUR ALKEN FUND ABSOLUTE RETURN EUROPE EUR -EU1-	171.260,68	20.806.460,13	8,26
EUR APS ASIA PACIFIC LONG SHORT FUND -D-	184.054,93	22.688.451,22	9,01
EUR DB PLATINUM IV CLINTON EQUITY STRATEGIES -I3C-E-	236.068,05	26.678.050,67	10,59
EUR DB PLATINUM SICAV - DB PLATINUM IVORY OPTIMAL -I5C-E- (reg. -S-)	248.227,04	21.657.809,41	8,60
EUR DNB FUND FCP - TMT ABSOLUTE RETURN -A-	264.322,33	28.562.406,98	11,34
EUR FUNDLOGIC ALTERNATIVES PLC - MS ALKEON UCITS FUND -C- EUR	10.507,76	13.039.599,81	5,18
EUR GAM STAR FUND - GAM STAR GLOBAL RATES	1.411.959,60	16.928.689,62	6,72
EUR MARSHALL WACE UCITS FUNDS - DEVELOPED EUROPE TOPS FUND -A- EUR	176.544,68	31.258.718,04	12,42
EUR MERRILL LYNCH INVESTMENT SOLUTIONS - COLUMBUS CIRCLE INVESTORS HEALTHCARE LONG-SHORT UC	156.947,64	19.174.293,67	7,61
EUR MERRYL LYNCH INVESTMENT SOLUTIONS SICAV - PASSPORT CAPITAL GLOBAL EQUITY LONG SHORT UCITS FUND -EUR D (acc)-	241.337,93	23.093.626,14	9,17
EUR SCHRODER GAIA EGERTON EUROPEAN EQUITY -C-	163.704,66	27.197.892,21	10,80
Fondsanteile (Open-End)		251.085.997,90	99,70
Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere: Investmentfonds			
		251.085.997,90	99,70
Total des Wertpapierbestandes		251.085.997,90	99,70
Bankguthaben und sonstige		3.766.680,94	1,50
Andere Passiva		-3.011.684,46	-1,20
Fondsvermögen		251.840.994,38	100,00

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.
Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Technische Daten und Erläuterungen**Technische Daten**

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B -Thesaurierend	EUR	11480397	LU0522193027	1,50%	3,18%
EB -Thesaurierend	EUR	24068259	LU1043183802	1,00%	2,70%
FB -Thesaurierend	EUR	11480404	LU0522193530	0,85%	2,53%
IB -Thesaurierend	EUR	11480406	LU0522193613	1,00%	2,68%
UB -Thesaurierend	EUR	25976324	LU1135114517	1,25%	2,97%
BH -Thesaurierend	CHF	11480412	LU0522194009	1,50%	3,18%
EBH -Thesaurierend	CHF	26121557	LU1141833001	1,00%	2,70%
FBH -Thesaurierend	CHF	12068361	LU0566061908	0,85%	2,54%
IBH -Thesaurierend	CHF	11480414	LU0522194348	1,00%	2,70%
UBH -Thesaurierend	CHF	25974704	LU1135115167	1,25%	2,98%
BH -Thesaurierend	GBP	12983829	LU0627515090	1,50%	3,19%
FBH -Thesaurierend	GBP	12068363	LU0566065560	0,85%	2,54%
IBH -Thesaurierend	GBP	11480416	LU0522194181	1,00%	2,66%
UBH -Thesaurierend	GBP	25974700	LU1135114947	1,25%	2,94%
BH -Thesaurierend	USD	11480410	LU0522193704	1,50%	3,19%
EBH -Thesaurierend	USD	26121558	LU1141850278	1,00%	2,69%
FBH -Thesaurierend	USD	12068362	LU0566063516	0,85%	2,54%
IBH -Thesaurierend	USD	11480417	LU0522194421	1,00%	2,71%
UBH -Thesaurierend	USD	25974707	LU1135115597	1,25%	2,94%

TER ohne performance fee ist: 3,18% für -B- ; 2,53% für -FB- EUR; 2,68% für -IB- EUR; 2,97% für -UB- EUR ; 3,18% für -BH- CHF; 2,70% für -EBH- CHF ; 2,54% für -FBH- CHF; 2,70% für -IBH- CHF; 2,98% für -UBH- CHF; 3,19% für -BH- GBP; 2,53% für -FBH- GBP; 2,66% für -IBH- GBP; 2,94% für -UBH- GBP; 3,19% für -BH- USD; 2,54% für -FBH- USD; 2,71% für -IBH- USD; 2,94% für -UBH- USD.

Fondsp performance

		YTD	Seit Auflegung	2015	2014	2013
B -Thesaurierend	EUR	-3,67%	/	-1,02%	1,83%	5,61%
EB -Thesaurierend	EUR	-3,46%	-6,90%	/	/	/
FB -Thesaurierend	EUR	-3,40%	/	-0,05%	2,72%	6,42%
IB -Thesaurierend	EUR	-3,46%	/	-0,38%	2,43%	6,27%
UB -Thesaurierend	EUR	-3,56%	-4,99%	/	/	/
BH -Thesaurierend	CHF	-3,95%	/	-2,09%	1,34%	5,49%
EBH -Thesaurierend	CHF	-3,75%	-7,72%	/	/	/
FBH -Thesaurierend	CHF	-3,69%	/	-1,16%	2,22%	6,32%
IBH -Thesaurierend	CHF	-3,75%	/	-1,47%	1,96%	5,97%
UBH -Thesaurierend	CHF	-3,85%	-6,30%	/	/	/
BH -Thesaurierend	GBP	-3,50%	/	-0,95%	1,81%	5,79%
FBH -Thesaurierend	GBP	-3,24%	/	0,04%	2,67%	6,64%
IBH -Thesaurierend	GBP	-3,30%	/	-0,40%	2,38%	6,44%
UBH -Thesaurierend	GBP	-3,40%	-4,73%	/	/	/
BH -Thesaurierend	USD	-3,41%	/	-0,97%	1,66%	5,69%
EBH -Thesaurierend	USD	-3,22%	-6,84%	/	/	/
FBH -Thesaurierend	USD	-3,16%	/	0,02%	2,54%	6,50%
IBH -Thesaurierend	USD	-3,21%	/	-0,34%	2,24%	6,35%
UBH -Thesaurierend	USD	-3,31%	-4,62%	/	/	/

Erläuterungen

Technische Daten und Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in EUR)
GBP	20.361.110,39	EUR	-26.161.005,24	06.06.2016	455.903,93
<i>Credit Suisse Lux</i>					
CHF	288.350.009,78	EUR	-263.011.434,52	06.06.2016	-2.464.634,33
<i>Credit Suisse Lux</i>					
USD	61.856.908,48	EUR	-54.579.304,07	06.06.2016	975.969,70
<i>Credit Suisse Lux</i>					
EUR	28.165,79	USD	-32.000,00	06.06.2016	-574,32
<i>Credit Suisse Lux</i>					
EUR	25.514,50	CHF	-28.000,00	06.06.2016	214,29
<i>Credit Suisse Lux</i>					
EUR	10.607.166,44	USD	-12.208.000,00	06.06.2016	-357.208,77
<i>Credit Suisse Lux</i>					
EUR	7.917.157,54	CHF	-8.696.000,00	06.06.2016	59.636,18
<i>Credit Suisse Lux</i>					
CHF	29.000,00	EUR	-26.407,16	06.06.2016	-203,39
<i>Credit Suisse Lux</i>					
EUR	140.329,41	GBP	-111.000,00	06.06.2016	-4.775,25
<i>Credit Suisse Lux</i>					
EUR	127.856,63	USD	-146.000,00	06.06.2016	-3.270,24
<i>Credit Suisse Lux</i>					
EUR	55.920,45	CHF	-62.000,00	06.06.2016	-101,40
<i>Credit Suisse Lux</i>					
EUR	181.415,97	CHF	-201.000,00	06.06.2016	-203,24
<i>Credit Suisse Lux</i>					
CHF	636.000,00	EUR	-575.272,51	06.06.2016	-596,74
<i>Credit Suisse Lux</i>					
EUR	1.159.064,94	CHF	-1.282.000,00	06.06.2016	677,56
<i>Credit Suisse Lux</i>					
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften					-1.339.166,02

Nettovermögensaufstellung in EUR und Fondsentwicklung

	31.05.2016
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	667.427.585,16
Bankguthaben und sonstige	35.138.155,99
	702.565.741,15
Passiva	
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	5.024.538,13
Rückstellungen für Aufwendungen	616.425,49
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	1.339.166,02
Andere Passiva	968,89
	6.981.098,53
Nettovermögen	695.584.642,62

Nettovermögensaufstellung in EUR und Fondsentwicklung

Fondsentwicklung		31.05.2016	30.11.2015	30.11.2014
Fondsvermögen	EUR	695.584.642,62	786.668.856,78	750.889.780,59
Nettoinventarwert pro Aktie				
B -Thesaurierend	EUR	103,75	107,82	108,84
EB -Thesaurierend	EUR	930,96	965,02	/
FB -Thesaurierend	EUR	1.085,58	1.124,46	1.123,89
IB -Thesaurierend	EUR	1.073,44	1.112,72	1.115,86
UB -Thesaurierend	EUR	95,01	98,60	/
BH -Thesaurierend	CHF	99,62	103,97	105,96
EBH -Thesaurierend	CHF	922,84	960,66	/
FBH -Thesaurierend	CHF	1.041,07	1.082,93	1.093,24
IBH -Thesaurierend	CHF	1.028,07	1.070,20	1.083,72
UBH -Thesaurierend	CHF	93,70	97,66	/
BH -Thesaurierend	GBP	101,77	105,52	106,46
FBH -Thesaurierend	GBP	1.051,97	1.087,18	1.085,99
IBH -Thesaurierend	GBP	1.058,79	1.095,05	1.098,73
UBH -Thesaurierend	GBP	95,27	98,65	/
BH -Thesaurierend	USD	103,62	107,33	108,34
EBH -Thesaurierend	USD	931,62	962,59	/
FBH -Thesaurierend	USD	1.068,78	1.103,48	1.102,87
IBH -Thesaurierend	USD	1.056,23	1.091,29	1.094,54
UBH -Thesaurierend	USD	95,38	98,67	/

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Periode	zu Beginn der Periode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
B -Thesaurierend	EUR	61.066,505	177.035,703	6.482,741	122.451,939
EB -Thesaurierend	EUR	9.277,791	8.775,501	1.194,445	692,155
FB -Thesaurierend	EUR	320.900,008	358.690,596	18.448,314	56.238,902
IB -Thesaurierend	EUR	8.934,000	21.540,137	1.095,000	13.701,137
UB -Thesaurierend	EUR	1.969,270	691,907	1.376,220	98,857
BH -Thesaurierend	CHF	6.086,146	53.320,505	1.905,000	49.139,359
EBH -Thesaurierend	CHF	38.401,424	35.035,174	3.980,279	614,029
FBH -Thesaurierend	CHF	229.135,904	195.234,070	42.910,393	9.008,559
IBH -Thesaurierend	CHF	3.065,253	6.576,129	513,325	4.024,201
UBH -Thesaurierend	CHF	6.959,062	2.147,960	4.909,953	98,851
BH -Thesaurierend	GBP	1.253,568	2.478,568	184,000	1.409,000
FBH -Thesaurierend	GBP	19.040,398	19.699,168	341,230	1.000,000
IBH -Thesaurierend	GBP	39,000	39,000	0,000	0,000
UBH -Thesaurierend	GBP	559,092	559,092	0,000	0,000
BH -Thesaurierend	USD	28.411,145	49.350,133	1.449,768	22.388,756
EBH -Thesaurierend	USD	2.637,703	2.637,703	0,000	0,000
FBH -Thesaurierend	USD	40.785,710	41.657,802	300,000	1.172,092
IBH -Thesaurierend	USD	469,000	11.841,502	1.578,500	12.951,002
UBH -Thesaurierend	USD	98,701	98,701	0,000	0,000

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens in EUR

Für die Periode vom
01.12.2015 bis zum
31.05.2016

Nettovermögen zu Beginn der Periode	786.668.856,78
Erträge	
Andere Erträge	157.520,00
	157.520,00
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	3.362.473,73
Depotbank- und Depotgebühr	149.891,17
Verwaltungskosten	337.972,36
Druck- und Veröffentlichungskosten	41.768,71
Zinsen und Bankspeisen	19.010,39
Kosten für Revision, Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	106.706,58
"Taxe d'abonnement"	16.213,00
	4.034.035,94
Nettoerträge (-verluste)	-3.876.515,94
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-4.849.770,77
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-8.744.452,05
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-987.511,24
	-14.581.734,06
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-18.458.250,00
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-18.430.646,19
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	-1.948.983,06
	-20.379.629,25
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	-38.837.879,25
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	71.439.033,36
Rücknahmen	-123.685.368,27
	-52.246.334,91
Nettovermögen am Ende der Periode	695.584.642,62

Geographische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestandes Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Geographische Aufteilung

Luxemburg	55,40
Irland	40,55
Total	95,95

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	95,95
Total	95,95

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Netto- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere: Investmentfonds			
Fondsanteile (Open-End)			
EUR ALKEN FUND ABSOLUTE RETURN EUROPE EUR -EU1-	286.122,21	34.760.987,29	5,00
EUR ALPHA QUANTMETRICS MULTI STRATEGY FUND -O-	12.114,20	10.707.987,20	1,54
EUR ALPHA UCITS SICAV - QUANTMETRICS MULTI STRATEGY FUND -L-	5.000,00	4.690.250,00	0,67
EUR DB PLATINUM SICAV - DB PLATINUM MCP TERRA GROVE PAN ASIA -I3C-E-	191.490,16	17.542.413,10	2,52
EUR DB PLATINUM IV CLINTON EQUITY STRATEGIES -I3C-E-	291.723,32	32.967.652,05	4,74
EUR DB PLATINUM IV DBX SYSTEMATIC ALPHA INDEX -I5C-E-	218.394,44	22.254.393,13	3,20
EUR DB PLATINUM IV SICAV - DB PLATINUM IV BASSO -I4C- -E-	351.710,22	35.199.158,82	5,06
EUR EXANE FUNDS 1 - EXANE ARCHIMEDES FUND -A-	1.032,35	18.480.466,91	2,66
EUR FORT GLOBAL UCITS FUNDS PLC - FORT GLOBAL UCITS CONTRARIAN FUND -I- EUR	22.000,00	22.153.120,00	3,18
EUR FUNDLOGIC ALTERNATIVES PLC - IPM SYSTEMATIC MACRO UCITS FUND -I- EUR	35.104,83	38.393.099,43	5,52
EUR GAM STAR EUROPEAN ALPHA -I-	416.230,73	48.191.193,92	6,93
EUR GAM STAR FUND - GAM STAR GLOBAL RATES	4.766.902,66	57.152.779,44	8,22
EUR GLG INVESTMENTS VI PLC - MAN AHL VOLATILITY ALTERNATIVE -IN H- EUR	149.141,03	14.803.738,44	2,13
EUR HEDGE INVEST INTERNATIONAL FUNDS - HI NUMEN CREDIT FUND -I2- EUR	177.960,02	17.497.029,17	2,52
EUR HENDERSON GARTMORE SICAV - UNITED KINGDOM ABSOLUTE RETURN FUND -G EUR ACC (HEDGED)	7.325.982,67	41.170.557,39	5,92
EUR HI NUMEN CREDIT FUND -A- EUR	64.687,33	7.046.390,86	1,01
EUR LEGG MASON GLOBAL FUNDS - LEGG MASON WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES BOND FUND EUR	375.708,28	40.696.720,67	5,85
EUR LYXOR NEWITS IRL - LYXOR/TIEDEMANN ARBITRAGE STRATEGY -I- EUR	252.601,03	25.114.428,18	3,61
EUR MARSHALL WACE UCITS FUNDS - DEVELOPED EUROPE TOPS FUND -A- EUR	267.234,40	47.316.095,64	6,80
EUR MERRILL LYNCH INVESTMENT SOLUTIONS - COLUMBUS CIRCLE INVESTORS HEALTHCARE LONG-SHORT UC	194.279,60	23.735.138,73	3,41
EUR MERRYL LYNCH INVESTMENT SOLUTIONS SICAV - YORK ASIAN EVENT-DRIVEN UCITS FUND -D-	244.271,31	26.681.754,75	3,84
EUR PICTET TOTAL RETURN SICAV AGORA -I- EUR	345.512,65	39.461.000,21	5,67
EUR SCHRODER GAIA SICAV - SCHRODER GAIA PAULSON MERGER ABRITRAGE -C- EUR	114.731,53	8.513.079,53	1,22
EUR SCHRODER GAIA SICAV - SCHRODER GAIA PAULSON MERGER ABRITRAGE -I- EUR	277.852,15	21.033.407,76	3,02
EUR VERITAS CHINA FUND -A-	96.808,81	11.864.742,54	1,71
Fondsanteile (Open-End)		667.427.585,16	95,95
Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere: Investmentfonds		667.427.585,16	95,95
Total des Wertpapierbestandes		667.427.585,16	95,95
Bankguthaben und sonstige		35.138.155,99	5,05
Andere Passiva		-6.981.098,53	-1,00
Fondsvermögen		695.584.642,62	100,00

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Technische Daten und Erläuterungen**Technische Daten**

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B -Thesaurierend	USD	26388691	LU1155685156	1,50%	1,79%
IB -Thesaurierend	USD	26388715	LU1155685669	1,00%	1,29%
UB -Thesaurierend	USD	28258592	LU1235127153	1,00%	1,23%
BH -Thesaurierend	CHF	26388706	LU1155685230	1,50%	1,79%
IBH -Thesaurierend	CHF	26388736	LU1155685743	1,00%	1,29%
BH -Thesaurierend	EUR	26388708	LU1155685313	1,50%	1,79%
IBH -Thesaurierend	EUR	26388738	LU1155685826	1,00%	1,28%
UBH -Thesaurierend	EUR	27003811	LU1184716956	1,00%	1,27%
BHX -Thesaurierend	GBP	26388712	LU1155685586	0,85%	1,13%
UBH -Thesaurierend	GBP	27004963	LU1184717178	1,00%	1,27%
BH -Thesaurierend	SEK	26388710	LU1155685404	1,50%	1,77%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung
B -Thesaurierend	USD	3,88%	-3,73%
IB -Thesaurierend	USD	4,11%	-3,15%
UB -Thesaurierend	USD	4,04%	-7,62%
BH -Thesaurierend	CHF	3,38%	-5,07%
IBH -Thesaurierend	CHF	3,60%	-4,54%
BH -Thesaurierend	EUR	3,52%	-4,20%
IBH -Thesaurierend	EUR	3,74%	-3,63%
UBH -Thesaurierend	EUR	3,73%	-2,47%
BHX -Thesaurierend	GBP	3,88%	-3,25%
UBH -Thesaurierend	GBP	3,83%	-2,65%
BH -Thesaurierend	SEK	3,25%	-4,23%

Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
Gegenpartei					(in USD)
USD	19.546,06	SEK	-162.374,00	15.06.2016	97,74
Goldman Sachs International (London)					
CHF	4.581.916,00	USD	-4.666.587,00	15.06.2016	-55.200,12
Goldman Sachs International (London)					
EUR	20.245.961,00	USD	-22.549.381,58	15.06.2016	-1.697,77
Goldman Sachs International (London)					
GBP	8.014.670,00	USD	-11.483.426,18	15.06.2016	182.110,34
Goldman Sachs International (London)					
SEK	7.167.098,00	USD	-863.110,84	15.06.2016	-4.674,79
Goldman Sachs International (London)					
USD	27.605,23	SEK	-229.446,00	15.06.2016	123,37
Goldman Sachs International (London)					
USD	63.577,81	GBP	-45.106,00	15.06.2016	-2.075,00
Goldman Sachs International (London)					
USD	5.539,42	SEK	-45.176,00	15.06.2016	128,42
Goldman Sachs International (London)					

Technische Daten und Erläuterungen

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in USD)
SEK	155.603,00	USD	-18.966,01	22.06.2016	-324,19
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
GBP	131.098,00	USD	-188.825,04	15.06.2016	1.991,11
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
EUR	323.543,00	USD	-365.287,49	15.06.2016	-4.961,53
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
CHF	72.928,00	USD	-75.526,10	15.06.2016	-2.129,03
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	65.609,81	GBP	-46.125,00	15.06.2016	-1.526,18
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	8.255,41	SEK	-68.366,00	15.06.2016	66,87
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	268.843,84	EUR	-239.193,00	15.06.2016	2.456,50
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
SEK	104.801,00	USD	-12.961,47	15.06.2016	-408,98
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	430,82	SEK	-3.499,00	15.06.2016	11,72
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	962.928,09	GBP	-678.558,00	15.06.2016	-24.728,53
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	25.039,89	EUR	-22.025,00	15.06.2016	510,71
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	12.251,49	SEK	-99.352,00	15.06.2016	351,47
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	64.022,23	EUR	-56.134,00	15.06.2016	1.505,87
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	510.354,85	EUR	-447.750,00	15.06.2016	11.696,45
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	219.745,26	GBP	-155.475,00	15.06.2016	-6.552,14
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
SEK	5.950,00	USD	-731,38	15.06.2016	-18,72
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	413.475,36	EUR	-362.698,00	15.06.2016	9.539,19
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	177.480,10	GBP	-125.789,00	15.06.2016	-5.608,65
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
SEK	49.750,00	USD	-6.117,34	15.06.2016	-158,56
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	87.609,41	CHF	-83.377,00	15.06.2016	3.693,99
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	13.794,32	SEK	-111.946,00	15.06.2016	385,84
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
SEK	29.999,00	USD	-3.721,60	15.06.2016	-128,48
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
SEK	100.273,00	USD	-12.367,54	15.06.2016	-357,38
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
SEK	129.431,00	USD	-15.960,77	15.06.2016	-458,23
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
EUR	532.148,00	USD	-600.477,93	15.06.2016	-7.831,09
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
CHF	123.942,00	USD	-128.573,21	15.06.2016	-3.834,02
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
GBP	194.523,00	USD	-275.258,80	15.06.2016	7.873,90
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					

Technische Daten und Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in USD)
USD	52.187,17	GBP	-36.278,00	15.06.2016	-616,29
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
SEK	173.168,00	USD	-21.455,21	15.06.2016	-714,09
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
CHF	53.238,00	USD	-55.173,49	15.06.2016	-1.593,06
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
EUR	224.938,00	USD	-255.237,37	15.06.2016	-4.726,62
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
GBP	83.445,00	USD	-119.998,08	15.06.2016	1.458,04
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	16.972,54	SEK	-137.661,00	15.06.2016	484,01
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
EUR	100.052,00	USD	-112.940,20	15.06.2016	-1.513,49
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	126.977,08	GBP	-87.340,00	15.06.2016	-148,30
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	125.478,06	CHF	-119.425,00	15.06.2016	5.281,87
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	172.356,14	GBP	-119.086,00	15.06.2016	-976,27
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
SEK	55.501,00	USD	-6.887,32	15.06.2016	-239,71
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	14.828,69	SEK	-119.496,00	15.06.2016	515,85
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	81.673,22	CHF	-78.060,00	15.06.2016	3.109,36
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	387.215,72	EUR	-336.551,00	15.06.2016	12.398,03
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
SEK	40.501,00	USD	-4.986,10	15.06.2016	-135,11
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	259.617,62	EUR	-227.463,00	15.06.2016	6.292,33
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	53.116,05	CHF	-51.466,00	15.06.2016	1.318,28
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	9.891,82	SEK	-80.591,00	15.06.2016	238,95
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	115.993,29	GBP	-80.533,00	15.06.2016	-1.224,33
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
SEK	5.950,00	USD	-731,41	15.06.2016	-18,75
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
GBP	95.665,00	USD	-138.418,17	15.06.2016	824,44
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
CHF	60.996,00	USD	-62.940,55	15.06.2016	-1.552,22
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
SEK	94.062,00	USD	-11.581,47	15.06.2016	-315,23
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
EUR	267.738,00	USD	-306.583,30	15.06.2016	-8.406,70
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	64.267,67	CHF	-62.673,00	15.06.2016	1.190,91
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	312.862,90	EUR	-275.829,00	15.06.2016	5.673,22
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	11.924,71	SEK	-98.142,00	15.06.2016	169,71
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					

Technische Daten und Erläuterungen**Devisentermingeschäfte**

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in USD)
USD	140.438,20	GBP	-97.055,00	15.06.2016	-827,58
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	81.174,24	EUR	-71.910,00	15.06.2016	1.088,50
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
SEK	224.999,00	USD	-27.191,17	15.06.2016	-242,01
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
SEK	96.645,00	USD	-11.586,76	15.06.2016	-11,15
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
CHF	62.942,00	USD	-63.618,26	15.06.2016	-271,42
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
EUR	274.621,00	USD	-307.695,80	15.06.2016	-1.853,69
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
GBP	98.204,00	USD	-143.160,32	15.06.2016	-222,14
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	1.197,72	SEK	-9.968,00	15.06.2016	3,81
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	1.376.865,99	CHF	-1.364.700,00	15.06.2016	3.387,58
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	1.365.020,98	CHF	-1.353.750,00	15.06.2016	2.563,47
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
USD	1.478.951,54	CHF	-1.465.042,00	15.06.2016	4.485,17
<i>Goldman Sachs International (London)</i>					
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften					124.745,47

Nettovermögensaufstellung in USD und Fondsentwicklung

	31.05.2016
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	76.286.903,37
Bankguthaben und sonstige	614.909,82
Forderungen aus Erträgen	384.305,78
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften	124.745,47
	77.410.864,44
Passiva	
Bankverbindlichkeiten und sonstige	91.264,16
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	80.738,00
Rückstellungen für Aufwendungen	97.086,69
	269.088,85
Nettovermögen	77.141.775,59

Fondsentwicklung		31.05.2016	30.11.2015
Fondsvermögen	USD	77.141.775,59	100.630.010,28
Nettoinventarwert pro Aktie			
B -Thesaurierend	USD	114,99	111,36
IB -Thesaurierend	USD	116,99	113,01
UB -Thesaurierend	USD	92,38	89,30
BH -Thesaurierend	CHF	91,36	89,09
IBH -Thesaurierend	CHF	92,45	89,92
BH -Thesaurierend	EUR	116,13	112,89
IBH -Thesaurierend	EUR	118,18	114,60
UBH -Thesaurierend	EUR	97,53	94,57
BHX -Thesaurierend	GBP	104,85	101,46
UBH -Thesaurierend	GBP	97,35	94,27
BH -Thesaurierend	SEK	957,66	934,03

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Periode	zu Beginn der Periode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
B -Thesaurierend	USD	172.634,937	249.379,659	2.850,000	79.594,722
IB -Thesaurierend	USD	193.505,089	283.590,519	0,000	90.085,430
UB -Thesaurierend	USD	200,000	200,000	5.000,000	5.000,000
BH -Thesaurierend	CHF	3.053,183	4.343,597	34,035	1.324,449
IBH -Thesaurierend	CHF	1.000,000	47.113,527	0,000	46.113,527
BH -Thesaurierend	EUR	63.949,603	78.532,423	870,925	15.453,745
IBH -Thesaurierend	EUR	108.534,754	109.434,754	0,000	900,000
UBH -Thesaurierend	EUR	98,919	98,919	0,000	0,000
BHX -Thesaurierend	GBP	43.511,164	56.580,764	0,000	13.069,600
UBH -Thesaurierend	GBP	27.799,535	27.799,535	0,000	0,000
BH -Thesaurierend	SEK	7.714,296	7.250,854	1.654,512	1.191,070

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens in USD

Für die Periode vom
01.12.2015 bis zum
31.05.2016

Nettovermögen zu Beginn der Periode	100.630.010,28
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	107.988,47
Dividenden (Netto)	958.168,60
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	6.957,79
	1.073.114,86
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	514.490,37
Depotbank- und Depotgebühr	17.569,19
Verwaltungskosten	43.923,37
Druck- und Veröffentlichungskosten	9.460,58
Zinsen und Bankspesen	821,02
Kosten für Revision, Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	28.025,93
"Taxe d'abonnement"	20.956,69
	635.247,15
Nettoerträge (-verluste)	437.867,71
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-3.917.353,10
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-1.622.512,18
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	2.601.803,50
	-2.938.061,78
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-2.500.194,07
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	3.485.841,93
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	2.324.080,79
	5.809.922,72
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	3.309.728,65
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	1.031.375,39
Rücknahmen	-27.829.338,73
	-26.797.963,34
Nettovermögen am Ende der Periode	77.141.775,59

Geographische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestandes Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Geographische Aufteilung

USA	36,79
Japan	22,93
Vereinigtes Königreich	15,57
Frankreich	6,63
Niederlande	6,36
Deutschland	4,02
Spanien	2,53
Irland	1,38
Singapur	1,36
Jersey	1,32
Total	98,89

Wirtschaftliche Aufteilung

Holding- und Finanzgesellschaften	13,09
Versicherungsgesellschaften	9,12
Fahrzeuge	7,88
Verkehr und Transport	6,72
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	6,63
Banken und andere Kreditinstitute	6,58
Chemie	6,55
Baugewerbe und -material	5,64
Diverse Dienstleistungen	4,23
Elektrische Geräte und Komponenten	4,13
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	4,09
Energie- und Wasserversorgung	4,07
Tabak und alkoholische Getränke	2,83
Computer und Netzwerkausrüster	2,77
Nahrungsmittel und Softdrinks	2,74
Diverse Handelsfirmen	2,66
Telekommunikation	2,59
Maschinen und Apparate	1,42
Einzelhandel und Warenhäuser	1,36
Graphisches Gewerbe, Verlage und Medien	1,32
Biotechnologie	1,29
Erdöl	1,18
Total	98,89

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Netto- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere: Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)			
Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)			
USD ACCENTURE -A-	8.941,00	1.063.710,77	1,38
EUR AEGON	175.156,00	900.864,97	1,17
USD AFLAC	15.070,00	1.046.762,20	1,36
EUR ALSTOM	40.029,00	1.005.770,76	1,30
USD AMERICAN AIRLINES GROUP	27.756,00	885.693,96	1,15
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	18.121,00	1.048.843,48	1,36
USD AMGEN	6.293,00	993.979,35	1,29
USD ARCHER-DANIELS MIDLAND	25.793,00	1.103.166,61	1,43
EUR ARKEMA FRANCE	13.062,00	1.072.273,36	1,39
GBP ASHTAD GROUP	76.542,00	1.087.341,62	1,41
GBP AUTO TRADER GROUP	189.599,00	1.084.538,52	1,41
USD BANK OF AMERICA	67.909,00	1.004.374,11	1,30
USD BAXTER INTERNATIONAL	23.306,00	1.005.886,96	1,30
GBP BELLWAY	29.108,00	1.157.892,88	1,50
GBP BERKELEY GROUP HOLDINGS	22.858,00	1.089.597,05	1,41
USD BERKSHIRE HATHAWAY -B-	6.970,00	979.563,80	1,27
GBP BRITISH AMERICAN TOBACCO	16.954,00	1.035.931,41	1,34
USD BROADCOM	6.797,00	1.049.184,92	1,36
USD CITIGROUP	21.757,00	1.013.223,49	1,31
USD CONSOLIDATED EDISON	14.225,00	1.042.123,50	1,35
EUR COVESTRO	26.813,00	1.137.567,20	1,47
JPY DAIHATSU MOTOR	73.100,00	1.000.548,15	1,30
JPY DAI-ICHI LIFE INSURANCE	78.100,00	1.028.493,23	1,33
JPY DAIICHI SANKYO	42.700,00	991.989,02	1,29
USD DELTA AIR LINES	23.509,00	1.021.701,14	1,32
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA (reg. shares)	64.904,00	910.043,89	1,18
USD DOW CHEMICAL	19.094,00	980.667,84	1,27
GBP EASYJET	48.094,00	1.073.122,85	1,39
USD ELI LILLY & CO	13.436,00	1.008.103,08	1,31
USD FACEBOOK -A-	9.422,00	1.119.427,82	1,45
USD FISERV	10.361,00	1.091.324,13	1,41
USD HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP	22.747,00	1.027.481,99	1,33
JPY HINO MOTORS	90.500,00	926.991,50	1,20
EUR IBERDROLA	146.882,00	996.795,89	1,29
JPY ITOCHU	79.000,00	991.195,10	1,28
JPY JAPAN POST BANK	81.400,00	973.232,88	1,26
USD JOHNSON & JOHNSON	9.076,00	1.022.774,44	1,33
JPY KIRIN HOLDINGS	68.500,00	1.151.291,56	1,49
JPY KOITO MANUFACTURING	23.800,00	1.122.347,88	1,45
EUR KONINKLUKE AHOLD	47.473,00	1.052.229,91	1,36
EUR KONINKLUKE VOPAK	19.935,00	1.039.281,27	1,35
USD LYONDELLBASELL INDUSTRIES -A-	11.432,00	930.107,52	1,21
USD MERCK & CO	18.286,00	1.028.770,36	1,33
USD METLIFE	21.934,00	999.093,70	1,30
JPY MITSUBISHI ELECTRIC	93.000,00	1.123.245,04	1,46
JPY MITSUBISHI HEAVY INDUSTRIES	271.000,00	1.098.856,60	1,42
JPY MS&AD INSURANCE GROUP HOLDINGS	35.900,00	1.023.540,80	1,33
JPY NEXON	66.200,00	1.088.161,86	1,41
EUR NN GROUP	29.234,00	976.830,69	1,27
EUR OSRAM LICHT (reg. shares)	19.910,00	1.060.142,74	1,37
JPY OTSUKA HOLDINGS	25.700,00	1.049.736,19	1,36
GBP PERSIMMON	35.686,00	1.091.809,75	1,42
USD PHILLIPS 66	11.592,00	931.533,12	1,21
USD PRUDENTIAL FINANCIAL	12.856,00	1.018.838,00	1,32
EUR RENAULT	10.248,00	962.200,14	1,25
GBP ROYAL MAIL	144.997,00	1.141.754,33	1,48
JPY SEKISUI HOUSE	56.500,00	1.011.757,74	1,31
JPY SEVEN & I HOLDINGS	24.500,00	1.047.995,96	1,36
GBP SEVERN TRENT	31.997,00	1.067.432,11	1,38
EUR SOCIETE GENERALE PARIS -A-	25.593,00	1.053.897,15	1,37
JPY SOMPO JAPAN NIPPONKOA HOLDINGS	36.000,00	1.014.706,21	1,32
USD SYSCO	22.133,00	1.064.818,63	1,38
GBP TAYLOR WIMPEY	381.463,00	1.140.431,61	1,48
EUR TELEFONICA	91.736,00	959.056,84	1,24
USD THE PRICELINE GROUP	768,00	971.005,44	1,26
USD TYSON FOODS -A-	15.843,00	1.010.466,54	1,31
USD UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	20.854,00	940.306,86	1,22
EUR VALEO	6.756,00	1.020.239,52	1,32
USD VALERO ENERGY	16.579,00	906.871,30	1,18
USD VISA -A-	13.049,00	1.030.088,06	1,34
GBP VODAFONE GROUP	309.949,00	1.041.445,40	1,35
GBP WPP 2012	43.779,00	1.014.437,48	1,32
USD XCEL ENERGY	26.148,00	1.081.742,76	1,40
JPY YAMAHA	34.600,00	1.048.248,43	1,36
Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)		76.286.903,37	98,89
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere:		76.286.903,37	98,89
Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)		76.286.903,37	98,89
Total des Wertpapierbestandes		76.286.903,37	98,89
Bankguthaben und sonstige		614.909,82	0,80
Bankverbindlichkeiten und sonstige		-91.264,16	-0,12
Andere Nettovermögenswerte		331.226,56	0,43

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.
Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Netto- vermögens
Fondsvermögen		77.141.775,59	100,00

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.
Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Technische Daten und Erläuterungen

Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
B -Thesaurierend	USD	24738993	LU1079703630	1,30%	2,49%
EB -Thesaurierend	USD	24739001	LU1079704018	0,50%	1,76%
UB -Thesaurierend	USD	26362635	LU1144419964	1,05%	2,24%
BH -Thesaurierend	CHF	25202830	LU1100796306	1,30%	2,49%
EBH -Thesaurierend	CHF	26080504	LU1138708265	0,50%	1,74%
UBH -Thesaurierend	CHF	26362925	LU1144420038	1,05%	2,27%
EBH -Thesaurierend	EUR	25392822	LU1108241495	0,50%	1,73%

Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2015
B -Thesaurierend	USD	-2,22%	-5,72%	-1,93%
EB -Thesaurierend	USD	-1,92%	-4,66%	-1,33%
UB -Thesaurierend	USD	-2,14%	-4,28%	/
BH -Thesaurierend	CHF	-2,94%	-7,76%	-3,15%
EBH -Thesaurierend	CHF	-2,62%	-5,50%	-2,57%
UBH -Thesaurierend	CHF	-2,87%	-6,27%	/
EBH -Thesaurierend	EUR	-2,39%	-5,01%	-2,10%

Erläuterungen

Finanzterminkontrakte

Beschreibung	Währung	Anzahl	Liquidationsbetrag	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>				(in USD)
EURO STOXX 50 INDEX -10- 06/16	EUR	-111,00	-3.388.830,00	25.126,06
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Finanzterminkontrakten				25.126,06

Gegenpartei: Credit Suisse Zürich

Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(in USD)
EUR	20.593.975,80	USD	-22.938.188,06	15.06.2016	-2.924,34
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	49.005.867,00	USD	-49.886.024,40	15.06.2016	-564.951,67
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
CHF	64.662,95	USD	-67.096,73	15.06.2016	-2.017,87
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	527.557,82	EUR	-468.056,59	15.06.2016	6.286,34
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	1.020.068,69	CHF	-977.250,30	15.06.2016	36.511,81
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	28.452,32	CHF	-27.615,45	15.06.2016	658,88
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	2.423,48	CHF	-2.351,30	15.06.2016	57,02
<i>Credit Suisse Zürich</i>					
USD	2.301,46	CHF	-2.277,75	15.06.2016	9,05
<i>Credit Suisse Zürich</i>					

Art		Verbindlichkeiten		Fälligkeit		Forderungen		Bewertung
Gegenpartei	Nennwert		ZS			Nennwert	ZS	(in USD)
CDS	USD 10.000.000,00	Protection premium	1,000%	20.09.2020		Japan		-325.005,00
<i>Credit Suisse International - London - United Kingdom</i>								
ERS		Pos. var.BCOM Index		19.10.2016	USD 76.500.000,00	Neg. var. BCOM Index RESET		-592.298,67
<i>UBS LTD - London - United Kingdom</i>								
ERS	USD 10.000.000,00	Neg. JHLXH2US Index	0,500%	21.07.2016		Pos. JHLXH2US Index		-58.333,10
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>								
ERS	USD 10.000.000,00	Neg. JHLXH2US Index	0,500%	21.07.2016		Pos. JHLXH2US Index		-45.454,24
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>								
ERS	USD 5.882.680,32	Neg. val. JMABCCPE Index RESET	0,500%	24.02.2017		Pos. val. JMABCCPE Index RESET		-48.857,55
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>								
ERS	USD 8.000.000,00	Neg. var. DBCMCVPU Index RESET	0,300%	15.12.2016		Pos. var. DBCMCVPU Index RESET		254.864,74
<i>Deutsche Bank LDN - London - United Kingdom</i>								
ERS	USD 3.000.000,00	Neg. var. MLCIUCOT Index RESET		24.02.2017		Pos. var. MLCIUCOT Index MONTHLY RESET		6.908,06
<i>Merrill Lynch International - London - United Kingdom</i>								
ERS	USD 6.000.000,00	Neg. var. MLFPMRUE Index		15.12.2016		Pos. var. MLFPMRUE Index MONTHLY RESET		28.759,24
<i>Merrill Lynch International - London - United Kingdom</i>								
ERS	USD 30.000.000,00	Neg. var.UBSOPPTE Index	0,150%	19.10.2016		Pos. var. UBSOPPTE Index		230.636,90
<i>UBS LTD - London - United Kingdom</i>								
ERS	USD 17.500.000,00	Neg. var.BCOMF1 Index	0,120%	19.10.2016		Pos. var.BCOMF1 Index RESET		132.664,64
<i>UBS LTD - London - United Kingdom</i>								
ERS	USD 13.000.000,00	Neg. var.BCOMF2 Index	0,130%	19.10.2016		Pos. var.BCOMF2 Index RESET		94.139,23
<i>UBS LTD - London - United Kingdom</i>								
ERS	USD 10.000.000,00	Neg. var.BCOMF3 Index	0,150%	19.10.2016		Pos. var.BCOMF3 Index RESET		74.788,39
<i>UBS LTD - London - United Kingdom</i>								
ERS	USD 6.000.000,00	Neg. var.BCOMF4 Index	0,160%	19.10.2016		Pos. var.BCOMF4 Index RESET		41.960,62
<i>UBS LTD - London - United Kingdom</i>								
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Swapkontrakten								-205.226,74

Nettovermögensaufstellung in USD und Fondsentwicklung

	31.05.2016
Aktiva	
Wertpapierbestand zum Marktwert	79.547.625,87
Bankguthaben und sonstige	2.895.903,19
Forderungen aus Zeichnungen	7.609,35
Forderungen aus Erträgen	2.367,74
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Finanzterminkontrakten	25.126,06
	82.478.632,21
Passiva	
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	28.499,05
Rückstellungen für Aufwendungen	48.759,48
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Swapkontrakten	205.226,74
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	517.922,13
	800.407,40
Nettovermögen	81.678.224,81

Fondsentwicklung		31.05.2016	30.11.2015	30.11.2014
Fondsvermögen	USD	81.678.224,81	86.866.016,05	71.135.176,70
Nettoinventarwert pro Aktie				
B -Thesaurierend	USD	94,28	96,65	98,59
EB -Thesaurierend	USD	953,44	973,86	987,38
UB -Thesaurierend	USD	95,72	98,03	/
BH -Thesaurierend	CHF	92,24	95,49	98,46
EBH -Thesaurierend	CHF	945,03	974,28	998,98
UBH -Thesaurierend	CHF	93,73	96,95	/
EBH -Thesaurierend	EUR	949,89	976,49	996,77

Anzahl der Aktien im Umlauf		am Ende der Periode	zu Beginn der Periode	Anzahl der ausgegebenen Aktien	Anzahl der zurückgenommenen Aktien
B -Thesaurierend	USD	729,439	1.189,592	0,000	460,153
EB -Thesaurierend	USD	13.957,077	16.281,901	840,943	3.165,767
UB -Thesaurierend	USD	958,798	958,798	0,000	0,000
BH -Thesaurierend	CHF	1.255,703	1.553,027	0,000	297,324
EBH -Thesaurierend	CHF	50.045,436	51.362,289	1.930,092	3.246,945
UBH -Thesaurierend	CHF	1.072,353	398,851	673,502	0,000
EBH -Thesaurierend	EUR	19.312,964	21.273,351	789,113	2.749,500

Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens in USD

Für die Periode vom
01.12.2015 bis zum
31.05.2016

Nettovermögen zu Beginn der Periode	86.866.016,05
Erträge	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	10.483,14
Bankzinsen	1.796,24
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	2.198,85
	14.478,23
Aufwendungen	
Verwaltungsgebühr	196.961,15
Depotbank- und Depotgebühr	19.465,87
Verwaltungskosten	43.607,81
Druck- und Veröffentlichungskosten	7.442,27
Zinsen und Bankspesen	10,31
Kosten für Revision, Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	86.714,74
"Taxe d'abonnement"	2.870,37
	357.072,52
Nettoerträge (-verluste)	-342.594,29
Realisierter Gewinn (Verlust)	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	50.243,50
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten	72.631,96
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	-524.593,27
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-2.244.573,73
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	450.949,72
	-2.195.341,82
Realisierter Nettogewinn (-verlust)	-2.537.936,11
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)	
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	-1.222.236,29
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Finanzterminkontrakten	69.122,19
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-10.050,03
Veränderung des (der) nichtrealisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	4.124.150,12
	2.960.985,99
Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung	423.049,88
Zeichnungen / Rücknahmen	
Zeichnungen	3.638.092,33
Rücknahmen	-9.248.933,45
	-5.610.841,12
Nettovermögen am Ende der Periode	81.678.224,81

Geographische und wirtschaftliche Aufteilung des Wertpapierbestandes

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Geographische Aufteilung

Luxemburg	40,64
USA	34,48
Irland	21,90
Griechenland	0,12
Deutschland	0,12
Cayman-Inseln	0,12
Schweiz	0,01
Total	97,39

Wirtschaftliche Aufteilung

Anlagefonds	62,54
Länder und Zentralregierungen	34,23
Edelmetalle und -steine	0,25
Erdöl	0,12
Telekommunikation	0,12
Maschinen und Apparate	0,12
Diverse Dienstleistungen	0,01
Total	97,39

Aufstellung des Wertpapierbestandes und anderer Nettovermögenswerte

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in USD)	% des Netto- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere			
Kaufoptionen (call)			
USD USD / HKD (call) -7.7635- 06.09.2016	2.500.000,00	4.687,50	0,01
Kaufoptionen (call)		4.687,50	0,01
Verkaufsoptionen (put)			
USD ISHARES IBOX \$ HIGH YIELD CORP BOND FD (put) -79- 17.06.2016	150,00	750,00	0,00
Verkaufsoptionen (put)		750,00	0,00
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere		5.437,50	0,01
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere: Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)			
Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)			
EUR HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATIONS	10.000,00	101.417,08	0,12
Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)		101.417,08	0,12
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere: Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)			
Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)		101.417,08	0,12
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere: Anleihen			
Anleihen			
EUR HECKLER & KOCH (reg. -S-) 9.5%/11-15.05.2018	100.000,00	98.975,72	0,12
USD NEWMONT MINING 3.5%/12-15.03.2022	200.000,00	200.376,00	0,25
EUR TRANSOCEAN (linked to rating changes) FRN 12-15.10.2017	100.000,00	97.375,00	0,12
USD US 10.11.2016	5.000.000,00	4.991.306,52	6,11
USD US 16-02.02.2017	7.000.000,00	6.975.385,76	8,54
USD US 21.07.2016	8.000.000,00	7.995.914,28	9,79
USD US 23.06.2016	8.000.000,00	7.998.528,00	9,79
Anleihen		28.357.861,28	34,72
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere: Anleihen			
Anleihen		28.357.861,28	34,72
Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere: Investmentfonds			
Fondsanteile (Open-End)			
USD ASPECT DIVERSIFIED TRENDS FUND -A- USD INSTITUTIONAL	80.011,51	9.636.858,18	11,81
USD CREDIT SUISSE (Lux) SMALL AND MID CAP ALPHA LONG/SHORT -IBH- USD	3.500,00	3.466.365,00	4,24
USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ABSOLUTE RETURN BOND FUND -EB- USD	30.000,00	3.086.400,00	3,78
USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ABSOLUTE RETURN BOND FUND -SB- USD	2.000,00	2.061.680,00	2,52
USD CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - FOCUSED BOND FUND -IB- USD	500,00	447.830,00	0,55
USD DB PLATINUM IV DBX SYSTEMATIC ALPHA INDEX -IIC-U-	60.000,00	7.607.400,00	9,31
USD HENDERSON GARTMORE FUND SICAV - UNITED KINGDOM ABSOLUTE RETURN FUND - G USD ACC (HEDGED)	1.643.398,75	9.274.027,83	11,36
USD LYXOR INVESTMENT STRATEGIES - EPSILON GLOBAL TREND FUND -I-	70.000,00	8.245.349,00	10,09
USD THEAM QUANT SICAV - EQUITY GURU LONG SHORT -I- USD -H-	60.000,00	7.257.000,00	8,88
Fondsanteile (Open-End)		51.082.910,01	62,54
Börsennotierte / an einem geregelten Markt geh. Wertpapiere: Investmentfonds			
Investmentfonds		51.082.910,01	62,54
Total des Wertpapierbestandes		79.547.625,87	97,39
Bankguthaben und sonstige		2.895.903,19	3,55
Andere Passiva		-765.304,25	-0,94
Fondsvermögen		81.678.224,81	100,00

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.
Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.



CS Investment Funds 4
5, rue Jean Monnet
L-2180 Luxembourg
www.credit-suisse.com