

JAHRESBERICHT UND GEPRÜFTER ABSCHLUSS
SOCIÉTÉ D'INVESTISSEMENT À CAPITAL VARIABLE
31. MÄRZ 2018

THREADNEEDLE (LUX)

Inhalt

Informationen zur Gesellschaft	3	Aufstellungen der Wertpapieranlagen	
Bericht des Verwaltungsrats	4	Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	56
Wertentwicklung	6	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	60
Sharia-Prüfbericht und Bescheinigung der Sharia-Konformität	7	Threadneedle (Lux) - European Social Bond*	66
Bericht des Abschlussprüfers	9	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	69
Abschluss:		Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	75
Konsolidierte Jahresabschlüsse für Threadneedle (Lux)	11	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	79
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	12	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	84
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	13	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	89
Threadneedle (Lux) - European Social Bond*	14	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	97
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	15	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	101
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	16	Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	104
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	17	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	106
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	18	Threadneedle (Lux) - Global Focus	115
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	19	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	116
Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	20	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	119
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	21	Threadneedle (Lux) - American	121
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	22	Threadneedle (Lux) - American Select	122
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	23	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	123
Threadneedle (Lux) - Global Focus	24	Threadneedle (Lux) - Asian Focus	125
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	25	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	126
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	26	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	128
Threadneedle (Lux) - American	27	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities*	130
Threadneedle (Lux) - American Select	28	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	132
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	29	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	134
Threadneedle (Lux) - Asian Focus	30	Threadneedle (Lux) - European Select	136
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	31	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	137
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	33	Threadneedle (Lux) - Greater China Equities	139
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities*	34	Threadneedle (Lux) - Global Technology	141
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	35	Threadneedle (Lux) - Mondrian Investment Partners - Emerging Markets Equity	143
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	36	Threadneedle (Lux) - UK Equities	145
Threadneedle (Lux) - European Select	37	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	146
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	38	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	147
Threadneedle (Lux) - Greater China Equities	39	Threadneedle (Lux) - STANLIB Global Emerging Markets Property Securities	148
Threadneedle (Lux) - Global Energy Equities*	40	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	150
Threadneedle (Lux) - Global Technology	41	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	151
Threadneedle (Lux) - Mondrian Investment Partners - Emerging Markets Equity	42	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities*	152
Threadneedle (Lux) - UK Equities	43	Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	153
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	44	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	155
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	46	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	156
Threadneedle (Lux) - STANLIB Global Emerging Markets Property Securities	47	Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity*	157
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	48	Erläuterungen zum Jahresabschluss	159
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	49	Gesamtrisiko (ungeprüft)	229
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities*	50	Informationen für Anteilinhaber (ungeprüft)	230
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	52	Informationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)	233
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	53	Performance der Anteilsklassen (ungeprüft)	234
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	54	Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)	250
Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity*	55	Inhaltsverzeichnis	252

*Siehe Erläuterung 1.

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

Informationen zur Gesellschaft

Gesellschaft

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

Eingetragener Sitz

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

Verwaltungsgesellschaft

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

Verwaltungsrat

Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini
Unabhängiger Direktor
Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Dominik Kremer
Leiter EMEA & Latin America Institutional Sales
Columbia Threadneedle Investments
Frankfurt am Main
Deutschland

Tony Poon (am 27. Juni 2017* als Verwaltungsratsmitglied zurückgetreten)
Leiterin der Verwaltung, Nordasien
Columbia Threadneedle Investments
Hongkong

Claude Kremer
Unabhängiger Direktor
Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Michelle Scrimgeour (am 27. Juni 2017 zum Verwaltungsratsmitglied berufen)
Chief Executive Officer, EMEA
Columbia Threadneedle Investments
London
Großbritannien

Jon Allen (am 28. Juli 2017 zum Verwaltungsratsmitglied berufen)
Head of Institutional Sales & Product Development, Asia Pacific
Columbia Threadneedle Investments
Singapur

*Das Datum, an dem die Gesellschaft das Schreiben der Commission de Surveillance du Secteur Financier erhalten hat, mit dem diese keine Einwände gegen die vorgeschlagenen Änderungen der Zusammensetzung des Verwaltungsrats erhebt.

Bericht des Verwaltungsrats

Der FTSE All-Share Index legte in den 12 Monaten bis zum 31. März 2018 um 1,25 % zu. Der Berichtszeitraum begann positiv und die globalen Aktien stiegen kräftig an, gestützt durch globale Wirtschaftsdaten und verbesserte Unternehmensergebnisse. Die hohen Gewinne im gesamten Jahr 2017 wurden im Februar und März 2018 leicht abgebaut, was zu einem weltweiten Abverkauf – und steigender Volatilität nach einer gedämpften Phase – führte, da befürchtet wurde, dass die umfangreichen Anreizmaßnahmen der Zentralbanken bald zu Ende gehen könnten.

In den Politiknachrichten im Vereinigten Königreich nährte die unerwartete Einberufung vorgezogener Neuwahlen im Jahr 2017 durch Premierministerin Theresa May die Hoffnung, dass dies zu einer größeren parlamentarischen Mehrheit für die Konservativen führen würde, was die Regierung bei den Brexit-Verhandlungen stärken würde. Allerdings endete die Wahl im Juni damit, dass die Konservativen ihre absolute Mehrheit verloren, was Sorgen bezüglich der Auswirkungen für den Brexit auslöste. Ende 2017 schlossen britische und europäische Beamte die erste Phase der Brexit-Verhandlungen ab und einigten sich auf einige wichtige Punkte, darunter die sogenannte „Scheidungsregelung“. Obwohl die Anleger weiterhin besorgt über die nächste Phase der Verhandlungen sind, wurde die Anlegerstimmung im März 2018 durch ein Abkommen zwischen dem Vereinigten Königreich und der EU über eine Übergangsvereinbarung nach dem Brexit beflügelt.

Der S&P 500 legte im Berichtszeitraum um 14,0 % zu, erreichte permanent Rekordhöhen und stieg außer im Februar und März 2018 jeden Monat an. Die US-Notenbank erhöhte im Juni die Zinssätze um 25 Basispunkte und hielt seine Prognose für eine weitere Zinsanhebung im Jahr 2017 (die schließlich im Dezember stattfand) und drei Erhöhungen im Jahr 2018 bei. Die US-Aktien erhielten weitere Unterstützung durch die Erwartung, dass der Kongress das Vorzeigeprojekt von Präsident Trump, das Gesetz zu Steuersenkungen, billigen würde. Das Gesetz, das schließlich am 20. Dezember verabschiedet wurde, sieht eine dauerhafte Senkung der Körperschaftsteuer von 35 % auf 21 % und eine geringere vorübergehende Senkung der Ertragsteuern vor. Im ersten Quartal 2018 kehrte jedoch die Volatilität an die Aktienmärkte zurück. Anfang März brachen die Aktien drastisch ein, als Trump hohe US-Importzölle auf Stahl und Aluminium ankündigte. Als er später Abgaben auf nicht näher bezeichnete chinesische Waren im Wert von 60 Milliarden Dollar anordnete, kam es zu einem erneuten Rückgang.

Für die europäischen Aktien verlief der Berichtszeitraum positiv, der MSCI Europe stieg um 0,13 %. Die Wirtschaft der Eurozone nahm Fahrt auf – 2017 war das beste Jahr für das BIP-Wachstum seit einem Jahrzehnt, die Arbeitslosigkeit erreichte ein Neun-Jahres-Tief und der Einkaufsmanagerindex erreichte den höchsten Stand seit fast 12 Jahren, bevor er sich leicht abkühlte. Die Unternehmensgewinne boten ebenfalls Grund zum Optimismus. Die Wirtschaft der Eurozone hat sich inzwischen ausreichend stabilisiert, sodass die Europäische Zentralbank mit dem Abbau der Anleihenkäufe beginnen kann, wobei die Dauer des Konjunkturprogramms bis mindestens September 2018 verlängert wurde.

Der MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index entwickelte sich im Berichtszeitraum stark, legte um 19,1 % zu und übertraf die entwickelten Märkte. Die asiatischen Märkte erlebten jedoch Anfang 2018 eine kurzfristige Volatilitätsspitze, als die Anleger durch ein über den Erwartungen liegendes Lohnwachstum in den USA verunsichert wurden, das die Angst vor einer höheren Inflation und einem steileren Verlauf der US-Zinserhöhungen schürte. Diese Volatilität setzte sich gegen Ende des Berichtszeitraums fort, ausgelöst durch Sorgen über die Handelsspannungen zwischen den USA und China, nachdem die Regierung Trump Zölle in Höhe von 25 % auf jährliche Importe aus China im Wert von bis zu 60 Milliarden Dollar angekündigt hatte. China setzte vor dem Hintergrund robuster Erträge, positiver Wirtschaftsdaten und eines über den Marktschätzungen liegenden BIP-Wachstums seine starke Entwicklung fort.

Der Topix zeigte in den 12 Monaten bis zum 31. März eine starke Performance und legte in Lokalwährung um 15,9 % zu. Zu Beginn des Berichtszeitraums schwächelte der Markt, als die Popularität von Premierminister Abe durch den Moritomo Gakuen-Skandal beeinträchtigt wurde, in dem er beschuldigt wurde, einen Grundstückskauf zu einem Preis genehmigt zu haben, der für den Betreiber der nationalistischen Grundschule sehr vorteilhaft war. Ab Mitte April ließen die Sorgen über den Skandal jedoch nach, und die Beliebtheitswerte von Premierminister Shinzo Abe erholten sich. Nach dem Erdrutschsieg von Abes Liberaldemokratischer Partei bei der vorgezogenen Parlamentswahl im Oktober schossen die japanischen Aktien in die Höhe.

Die Schwellenmarktaktien verzeichneten ein äußerst starkes Jahr. Sie stiegen im Berichtszeitraum um 22,4 % und übertrafen damit die entwickelten Märkte. Obwohl Präsident Michel Temer in Brasilien letztendlich von Korruptionsvorwürfen freigesprochen wurde, sah sich seine Regierung vor Herausforderungen gestellt, die den Fortschritt wichtiger Gesetze in Bereichen wie der Rentenpolitik behinderten. Am Ende des Berichtszeitraums senkte Fitch Brasilien auf BB- und äußerte sich enttäuscht über die mangelnden Fortschritte des Landes bei den finanzpolitischen Reformen. Mexiko setzte zunächst seine Erholung fort, die von einer Abschwächung der US-Handelsrhetorik und soliden Daten in Bezug auf BIP, Handel und Arbeitsmarkt getragen wurde. Die Wachstumsaussichten wurden jedoch später aufgrund der Sorgen über den Verlauf der Verhandlungen zum Nordamerikanischen Freihandelsabkommen (NAFTA) nach unten korrigiert. In Südafrika kam es später im Berichtszeitraum zu einer Marktrally, als Cyril Ramaphosa den skandalgebeutelten Jacob Zuma bei den Wahlen um den Vorsitz des regierenden African National Congress (ANC) besiegte. Im darauf folgenden Februar wurde Cyril Ramaphosa Präsident.

Kern-Staatsanleihen hatten ein schwieriges Jahr, da sich die Anleger auf eine Welt mit weniger „leichtem Geld“ einstellten und Risiko vor dem Hintergrund von Optimismus gegenüber starken Unternehmensgewinnen und Wirtschaftsindikatoren bevorzugten. Auch die Erwartung, dass Präsident Trump seine wachstumsfreundliche Politik umsetzen würde, belastete die Kernanleihen. Trumps Versuch, Obamacare rückgängig zu machen, scheiterte, jedoch erreichte er kurz vor Weihnachten sein Ziel, die US-Steuergesetzgebung zu reformieren. Trotz der Abschwächung am Ende des Berichtszeitraums entwickelte sich die Verschuldung der Schwellenmärkte (EM) über den gesamten Zeitraum gut, wobei der JP Morgan EMBI Global Index auf US-Dollar-Basis 2,2 % erreichte.

Im Bereich der Schwellenmarktanleihen waren die Fundamentaldaten während des Berichtszeitraums größtenteils positiv, was die Risikoanlagen unterstützte und für weiterhin attraktive Renditen sorgte. Die Handelsbedenken gingen zunächst zurück, als die USA ihre Rhetorik gegenüber Mexiko abschwächten, lebten jedoch später aufgrund der langsamen Fortschritte bei den NAFTA-Neuverhandlungen und der Aussicht eines Handelskrieges zwischen China und den USA wieder auf. Das externe Umfeld blieb weitgehend unterstützend, wobei der US-Dollar schwächer wurde und die Renditen in den Kernmärkten während eines Großteils des Berichtszeitraums niedrig blieben. Zu Beginn des Jahres 2018 begannen die Renditen von US-Staatsanleihen jedoch zu steigen, da ein beschleunigtes Lohnwachstum die Angst vor einem schnelleren Tempo bei den Zinserhöhungen schürte. Im Jahr 2018 dürften sich die gesunden Zuflüsse in die Rentenmärkte der Schwellenländer fortsetzen, die durch ein schnelleres Wachstum der EM-Volkswirtschaften im Vergleich zu den Industrieländern angetrieben werden. Das EM-Wachstum dürfte von den großen Volkswirtschaften, die die Wende geschafft haben oder gerade vollziehen, sowie von einer breiteren Erholung in ganz Lateinamerika getragen werden. Trotz der steigenden Renditen für US-Staatsanleihen erwarten wir, dass sich die Spreads als widerstandsfähig erweisen werden, insbesondere in Hochzinsbereich, wo das Spread-Polster stärker ausgeprägt ist und die Fundamentaldaten günstig sind. Spezifische länderspezifische Themen werden auch weiterhin der Schlüssel zur Gesamtperformance der Schwellenmärkte sein, nicht zuletzt in Märkten wie der Türkei, Südafrika und Venezuela.

Bericht des Verwaltungsrats

(Fortsetzung)

Zu den wichtigsten neuen Positionen im Global Focus Fund gehörten das indische Finanzinstitut Kotak Mahindra Bank und der Sportartikelhersteller Adidas. Wir glauben, dass Kotak die Erträge weiter steigern kann, unterstützt durch ein schnelles Kreditwachstum, technologische Innovationen und wirtschaftliche Transparenz. Adidas gewinnt in einer relativ konzentrierten Branche weiterhin Marktanteile, und die Margen sollten sich verbessern, da das Direct-to-Consumer-Modell des Unternehmens über die Website und die Markengeschäfte aufgebaut wird. Das neue, angesehene Management und das durch personalisierte Produkte erzielte Umsatzwachstum bieten weitere Unterstützung für das Anlageargument. Die Positionen in Microsoft und dem japanischen Sensorhersteller Keyence wurden aufgestockt. Letzterer ist unseres Erachtens ein gut eingeführter, hochprofitabler und gut diversifizierter Nutznießer der strukturellen Automatisierungstrends. Zu den Verkäufen gehörten Visa und S&P Global; wir waren der Ansicht, dass deren Risiko-Ertrags-Profil im Vergleich zu anderen Titeln an Attraktivität verloren hatte.

In den American und Select Fonds bauten wir im Lauf des Geschäftsjahres ein Engagement in Finanztiteln auf; der Sektor ist gut aufgestellt, um von einer gesunden US-Wirtschaft und steigenden Zinsen sowie von einer Lockerung der Regulierung unter der Trump-Regierung zu profitieren. Zu den wichtigsten neuen Positionen im Finanzsektor gehörten Citizens Financial Group und Bank of America im American Fund und JP Morgan Chase im Select Fund. Ansonsten war die Sektorallokation im American Fund während des Geschäftsjahres relativ stabil, wobei wir die Bestände im Technologiesektor erhöhten – hier umfassten die neuen Positionen unter anderem hochwertige Wachstumstitel wie Micron Technology und MasterCard – und die Bestände in nicht-zyklischen Konsumgütern und Immobilien verringerten. Zu den weiteren Neuzugängen im Select Fund gehörten UnitedHealth Group, dessen vielfältiger Mix aus Dienst- und Zusatzleistungen ihm im Vergleich zu seinen Mitbewerbern auf dem Weg zu einer wertorientierten Gesundheitsversorgung Vorteile verschafft, und Boeing, wo die verbesserte Produktion der B787 zu einer deutlichen Verbesserung des freien Cashflows beiträgt.

Unser Hauptaugenmerk bei der Verwaltung des European Select Fund liegt auf der Titelauswahl. Wir wollen qualitativ hochwertige Unternehmen identifizieren, von denen aufgrund ihrer Preissetzungsmacht nachhaltige Erträge zu erwarten sind. Zu den neuen Positionen im Laufe des Geschäftsjahres gehörten Adidas und ASML. Das Sportbekleidungsunternehmen Adidas hat ein neues Management, gewinnt Marktanteile und hat eine starke Position in China. Seine Verkaufsstrategie traf mit Produkten wie Retro-Schuhen voll ins Schwarze. ASML stellt Halbleiterfertigungsanlagen her und verfügt über einen großen Marktanteil und überlegene Technologie. Das Unternehmen ist führend in der Extrem-Ultraviolett-Lithografie (EUV), die ein spannendes Wachstumspotenzial bietet. Wir verkauften Roche. Das Pharmaunternehmen steht durch die Entwicklung von Biosimilar-Medikamenten zunehmend unter Druck. Zu den weiteren Verkäufen zählte das im Fahrzeugsicherheitsunternehmen Autoliv nach einer Phase hoher Renditen.

Neuzugänge im britischen Portfolio waren unter anderem Rotork, Weir, Cobham und Whitbread. Rotork sollte von der Rückkehr der Investitionen im Öl- und Gasbereich profitieren, sowie von der Branchenkonsolidierung und einem Managementteam, das über den Zyklus hinweg gut investiert hat, um das Angebot des Unternehmens zu verbessern. Weir ist gut aufgestellt, um von einem Anstieg der Investitionsausgaben zu profitieren, da sich die Rentabilität im Rohstoffsektor verbessert. Cobham hat unserer Ansicht nach ein stabiles zugrunde liegendes Geschäft, das zahlreiche Möglichkeiten zur Wertschöpfung bietet. Whitbread hat in seinem Hotelbereich eine signifikante Ertragssteigerungschance. Tesco wurde nach der Übernahme von Booker, das wir zuvor gehalten haben, ebenfalls zum Portfolio hinzugefügt. Wir sehen die Übernahme positiv, ebenso den von Tesco abgeschlossenen Deal bezüglich des Pensionsfonds, die verbesserte operative Performance und die Fokussierung auf den Cashflow. Unsere Position in Bellway wurde mit Gewinn glattgestellt. Zu den weiteren Abgängen gehörten Berendsen und Amec Foster Wheeler; beide Unternehmen hatten wir während des Berichtszeitraums erworben.

In allen drei asiatischen Aktienfonds behielten wir ein starkes Engagement in chinesischen Aktien bei, das sich während des ganzen Geschäftsjahres als Anker für die Performance erwies. Die Fonds erlebten eine starke Marktrally, die von einer Trendwende in den Risikowahrnehmungen gegenüber China nach Jahren stetigen Wachstums angetrieben wurde. Die Befürchtungen einer Finanzkrise in China, die sich auf den Anstieg der Schuldenquote konzentrierten, ließen nach, als die politischen Entscheidungsträger Maßnahmen zur Steuerung der Risiken im Finanzsystem ergriffen. Innerhalb Asiens war der Technologiesektor ein herausragender Akteur im Geschäftsjahr; Samsung Electronics beispielsweise stieg vor dem Hintergrund der starken Nachfrage nach elektronischen Bauteilen wie Arbeitsspeichern um mehr als 60 %. Im Online-Sektor erzielten chinesische Schwergewichte wie Alibaba und Tencent aufgrund einer Kombination aus Gewinnwachstum und einer Neubewertung der Bewertung noch stärkere Zuwächse. Gegen Ende des Geschäftsjahres nahmen wir nach und nach Gewinne mit und wechselten zu anderen Sektoren, während wir eine Übergewichtung gegenüber China beibehielten. Zum Ende des Geschäftsjahres waren die Fonds weiterhin untergewichtet in Bezug auf Indien und Australien.

Im European Strategic Bond Fund war der Handel mit Staatsanleihen die vorherrschende Aktivität im Jahresverlauf. Wir fügten dem Portfolio Anleihen aus Italien, dem Vereinigten Königreich und den Niederlanden hinzu. Wir stockten die Positionen in Bundesanleihen auf, reduzierten jedoch die Bestände in französischen Staatsanleihen. Bei den spanischen Staatsanleihen wechselten wir von einer bis 2046 laufenden Anleihe zu einem Papier mit Fälligkeit im Jahr 2019. Zu den Neuzugängen bei den Unternehmensanleihen gehörten DS Smith und Severn Trent. Unter anderem wurden die Positionen in Akelius Residential und Grand City Properties aufgestockt. Zu den Abgängen zählten Anglo American, Northern Ireland Electricity und Wind Acquisition Finance. Darüber hinaus hat der Fonds sein Engagement in Schwellenländern ausgebaut, wo wir die fundamentalen Rahmenbedingungen im Vergleich zu den Schultiteln des inländischen Markts für attraktiver halten.

Dominik Kremer
Verwaltungsratsmitglied

25. Juni 2018

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

Wertentwicklung

Erlöse der Threadneedle (Lux) Portfolios für das Geschäftsjahr zum 31. März 2018.

Portfolio	Einjährige Rendite**		
		Klasse A	Klasse W
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	AU	5,79 %	5,92 %
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	AU	2,46 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - European Social Bond*	IE	1,00 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	AE	0,93 %	0,95 %
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	AU	3,65 %	4,03 %
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	AU	4,53 %	4,89 %
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	AU	3,09 %	3,26 %
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	AU	1,60 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	AU	1,12 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	AU	4,32 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	AU	9,38 %	9,34 %
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	AU	5,08 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Focus	AU	20,25 %	20,34 %
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	AU	20,78 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	AE	10,41 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - American	AU	15,80 %	16,21 %
Threadneedle (Lux) - American Select	AU	14,85 %	14,97 %
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	AU	26,60 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - Asian Focus	AU	29,83 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	AU	24,51 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	AU	9,40 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities*	AU	13,10 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	AE	0,52 %	0,62 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	AE	12,24 %	12,17 %
Threadneedle (Lux) - European Select	AE	4,21 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	AU	23,10 %	22,90 %
Threadneedle (Lux) - Greater China Equities	AU	40,95 %	40,74 %
Threadneedle (Lux) - Global Technology	AU	23,14 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - UK Equities	AG	-1,37 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	AG	-3,39 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	AU	2,33 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	AEC	-1,67 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities*	AE	0,00 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	AU	1,24 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	AE	-1,78 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	AU	1,93 %	k. A.
Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity*	AU	15,18 %	k. A.

Portfolio	Klasse	Einjährige Rendite**
Threadneedle (Lux) - Mondrian Investment Partners - Emerging Markets Equity	M	14,10 %
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	IU	30,00 %
Threadneedle (Lux) - STANLIB Global Emerging Markets Property Securities	IU	20,79 %

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

*Siehe Erläuterung 1.

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



GATEHOUSE BANK



Shariah-Prüfbericht

Der Verwaltungsrat
Verwaltungsgesellschaft
74, Mühlenweg
L-2155 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg,

Sehr geehrte Damen und Herren,

As-salaamu Alaikum

Wir sind gemäß einem am 30. März 2017 abgeschlossenen Shariah-Beratungsvertrag zwischen Threadneedle Management Luxembourg S.A. in seiner Eigenschaft als Verwaltungsgesellschaft von Threadneedle (Lux) (die **Verwaltungsgesellschaft** bzw. die **SICAV**) und Gatehouse Bank Plc (der **Shariah-Berater**) in Bezug auf den Threadneedle (Lux) – Gatehouse Shariah Global Equity (der „**Shariah-Teilfonds**“) zur Vorlage dieses Sharia-Prüfberichts verpflichtet.

Die im Shariah-Beratungsvertrag definierten Begriffe haben in diesem Bericht dieselbe Bedeutung.

Wir haben eine Shariah-Prüfung durchgeführt und in diesem Zusammenhang die Anlagen untersucht, die während des Berichtszeitraums vom **1. April 2017 bis 30. September 2017** vom Shariah-Teilfonds getätigt wurden (die „**Shariah-Prüfung**“). Des Weiteren haben wir das Shariah-Aufsichtsgremium konsultiert und diesem unsere Ergebnisse vorgelegt. Das Shariah-Aufsichtsgremium hat die Arbeit des Shariah-Beraters geprüft und bestätigt, dass die Anlagen und die Berechnung der zu reinigenden Erträge innerhalb der vereinbarten Shariah-Richtlinien und -Parameter liegen.

Nach der Shariah-Prüfung empfiehlt der Shariah-Berater dem Shariah-Teilfonds die Reinigung eines Betrags von 372,2 USD in Bezug auf die im obigen Berichtszeitraum erhaltenen Dividenden und eine Spende für wohltätige Zwecke, die mit dem Shariah-Aufsichtsgremium abzustimmen ist. Es wird nicht erwartet, dass der Shariah-Teilfonds während dieses Berichtszeitraums eine Reinigung der Kapitalgewinne vornehmen wird.

Und Allah weiß es am besten.

Datum: 21. November 2017

Unterzeichnet für und im Namen des Shariah-Aufsichtsgremiums:

Mufti Muhammad Nurullah Shikder



Bescheinigung der Shariah-Konformität

Der Verwaltungsrat
Verwaltungsgesellschaft
74, Mühlenweg
L-2155 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg,

Datum: 8. Mai 2018

Sehr geehrte Damen und Herren,

As-salaamu Alaikum

Wir sind gemäß einem am 30. März 2017 abgeschlossenen Shariah-Aufsichtsgremium-Vertrag zwischen Threadneedle Management Luxembourg S.A. in seiner Eigenschaft als Verwaltungsgesellschaft von Threadneedle (Lux) (die **Verwaltungsgesellschaft** bzw. die **SICAV**) und uns (das **Shariah-Aufsichtsgremium**) in Bezug auf den Threadneedle (Lux) – Gatehouse Shariah Global Equity (der „**Shariah-Teilfonds**“) zur Vorlage dieser Bescheinigung der Shariah-Konformität verpflichtet.

Die im Shariah-Aufsichtsgremium-Vertrag definierten Begriffe haben in diesem Dokument dieselbe Bedeutung.

Wir haben eine Shariah-Prüfung durchgeführt und in diesem Zusammenhang die Anlagen untersucht, die während des Berichtszeitraums vom **1. Oktober 2017 bis 30. März 2018** vom Shariah-Teilfonds getätigt wurden (die „**Sharia-Prüfung**“). Wir haben uns auch mit dem Shariah-Berater beraten und seine Arbeit überprüft. Nach der Durchführung der Shariah-Prüfung haben wir diese Bescheinigung der Sharia-Konformität ausgestellt.

Diese Bescheinigung bestätigt unsere Feststellung, dass die Anlagen, sofern nicht anders angegeben, in Übereinstimmung mit den Shariah-Richtlinien getätigt wurden, die im Verkaufsprospekt für den Shariah-Teilfonds aufgeführt sind.

In Anbetracht des Vorstehenden sind wir der Ansicht, dass die Anlagen des Shariah-Teilfonds, abgesehen von den zur Reinigung empfohlenen Beträgen, auf Sharia-konforme Weise erfolgten, und dass daher die Erträge des Shariah-Teilfonds (vorbehaltlich der entsprechenden Reinigung) und alle nachfolgenden Renditen für die Anleger als rechtmäßig angesehen werden können.

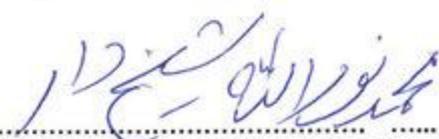
Und Allah weiß es am besten.

Datum: 8. Mai 2018

Unterzeichnet für und im Namen des Shariah-Aufsichtsgremiums des Shariah-Teilfonds von:

.....
Dr Sheikh Nidham Yaquby


.....
Dr Sheikh Abdulaziz Al Qassar


.....
Mufti Muhammad Nurullah Shikder



Bericht des Abschlussprüfers

An die Anteilinhaber von
Threadneedle (Lux)

Unser Testat

Nach unserer Auffassung vermittelt der beigefügte Abschluss in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Erstellung und Darstellung des Abschlusses ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage von Threadneedle (Lux) und seiner einzelnen Teilfonds (die „SICAV“) zum 31. März 2018 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Nettovermögens für das entsprechende Jahr.

Was wir geprüft haben

Der Abschluss der SICAV umfasst:

- die Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2018;
- die Portfolioaufstellungen zum 31. März 2018;
- die Ertrags- und Aufwandsrechnung und die Veränderungen des Nettovermögens für das entsprechende Jahr; und
- die Erläuterungen zum Abschluss, die eine Zusammenfassung der wesentlichen Bilanzierungsgrundsätze enthalten.

Grundlage für unser Testat

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

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

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

Sonstige Informationen

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

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

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

Verantwortungen des Verwaltungsrats der SICAV für den Jahresabschluss

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

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

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

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



Verantwortlichkeiten der Wirtschaftsprüfer für die Prüfung des Abschlusses

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

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

Zu unseren weiteren Aufgaben gehören:

- Die Identifizierung und Bewertung der Risiken wesentlicher falscher Angaben im Abschluss, sei es aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, die Planung und Durchführung von Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken und die Erlangung von Prüfungsnachweisen, die eine ausreichende und geeignete Grundlage für unser Testat darstellen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen nicht entdeckt werden, ist höher als bei wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von Irrtümern, da dolose Handlungen Absprachen, Fälschungen, absichtliche Auslassungen, falsche Darstellungen oder die Umgehung der internen Kontrolle beinhalten können;
- die Erlangung eines Verständnisses der für die Prüfung relevanten internen Kontrollstrukturen, um die unter diesen Umständen angemessenen Prüfungshandlungen festzulegen, nicht jedoch, um ein Testat über die Wirksamkeit des internen Kontrollsystems der SICAV abzugeben;
- die Bewertung der Eignung der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze und der Angemessenheit der vom Verwaltungsrat der SICAV vorgenommenen Schätzungen;
- eine Schlussfolgerung darüber, ob der vom Verwaltungsrat der SICAV angewandte Grundsatz der Unternehmensfortführung angemessen ist, und ob auf der Grundlage der gewonnenen Prüfungsnachweise eine wesentliche Unsicherheit in Bezug auf Ereignisse oder Umstände besteht, die erhebliche Zweifel an der Fortführungsfähigkeit der SICAV begründen können. Wenn wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, in unserem Prüfungsbericht auf die entsprechenden Angaben im Abschluss hinzuweisen, oder, falls diese Angaben nicht ausreichend sind, unser Testat zu ändern. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den Prüfungsnachweisen, die wir bis zum Datum unseres Prüfungsberichts erhalten haben. Zukünftige Ereignisse oder Bedingungen können jedoch dazu führen, dass die SICAV nicht mehr fortgeführt werden kann;
- die Beurteilung der Gesamtdarstellung, der Struktur und des Inhalts des Abschlusses, einschließlich der Abschlussangaben, und der Frage, ob der Abschluss die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild entsteht.

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

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Vertreten durch

Luxemburg, 25. Juni 2018

Steven Libby

Konsolidierte Jahresabschlüsse für Threadneedle (Lux)

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2, 18	5.321.916.031
Bankguthaben	2	176.901.977
Termineinlagen	2, 21	143.390.094
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		11.835.759
Forderungen aus Zeichnungen		24.115.643
Erhaltene Vermögensverwaltungsgebühr	2	7.300
Zinsforderungen aus Swapgeschäften	2	3.421.399
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		18.648.771
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	2.201.647
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	2, 10	2.103.479
Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften	2, 11	2.286.000
Sonstige Vermögenswerte	20	5.054.920
Summe Aktiva		5.711.883.020
Passiva		
Überziehungskredite		(1.968.717)
Zum Marktwert verkaufte Optionen	2, 12	(122.854)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(31.925.495)
Zahlbare Rücknahmen		(16.965.281)
Zahlbare Rückerstattungen der Vermögensverwaltungsgebühr	2	(13)
Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(1.162.585)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(217.105)
Eingegangene Vorauszahlung aus Swapgeschäften		(1.468)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(9.860.478)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swapgeschäften	2, 10	(6.824.539)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften	2, 11	(638.643)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(4.069.966)
Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	8	(2)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(480.992)
Andere Verbindlichkeiten		(1.197.407)
Summe Passiva		(75.435.545)
Nettovermögen insgesamt		5.636.447.475

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		4.408.021.554
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	66.755.550
Zinsen aus Anleihen, netto	2	48.226.261
Zinsen aus Bankguthaben	2	2.755.507
Zinsen aus Swapgeschäften		1.303.667
Zinsen aus Finanztermingeschäften		38.598
Provision für Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen	5	536.880
Rückerstattungen der Vermögensverwaltungsgebühr	2	12.834
Andere Erträge		44.083
Erträge insgesamt		119.673.380
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(48.145.179)
Performancegebühren	8	(503)
Bankspesen		(367.989)
Dividendenausschüttung Aufwendungen		(1.115.618)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(3.622.027)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(25.649)
Sonstige Betriebskosten	5	(13.969.047)
Depot- und Unterdepotgebühren	5	(111.633)
Vertriebsgebühr	5	(65)
Sonstige Gebühren	4	(80.970)
Aufwendungen insgesamt		(67.438.680)
Nettoertrag aus Anlagen		52.234.700
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		274.702.687
Realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften		4.094.304
Realisierter Netto(verlust) aus Optionen		(1.509.659)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		130.333.026
Realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften		(6.615.962)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(1.921.883)
Realisierter Netto(verlust) aus Steuerrückforderung		3.211
Realisierter Nettogewinn		399.085.724
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		134.424.334
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swapgeschäften		6.615.397
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Optionen		378.341
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(19.736.501)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Finanztermingeschäften		1.744.865
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Kapitalertragsteuer		(30.960)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		123.395.476
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		574.715.900
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		3.182.641.921
Anteilrücknahmen		(2.618.049.730)
Dividendenausschüttung	7	(29.079.455)
Kapitalbewegungen insgesamt		535.512.736
Wechselkursdifferenzen	2	138.834.791
Änderung der gegenseitigen Anlagen in Portfolios	18	(20.637.506)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		5.636.447.475

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	16.228.085
Bankguthaben	2	1.377.627
Forderungen aus Zeichnungen		24.566
Zinsforderungen aus Swapgeschäften	2	16.491
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		150.965
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	48.653
Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften	2, 11	54.490
Sonstige Vermögenswerte		374
Summe Aktiva		17.901.251
Passiva		
Zahlbare Rücknahmen		(3.884)
Zahlbare Rückerstattungen der Vermögensverwaltungsgebühr	2	(9)
Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(20.404)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swapgeschäften	2, 10	(22.515)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(13.052)
Andere Verbindlichkeiten		(4.181)
Summe Passiva		(64.045)
Nettovermögen insgesamt		17.837.206

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	85.512,786
Klasse AU	570.475,942
Klasse DEC	32.878,702
Klasse DEH	43.307,904
Klasse DU	23.051,092
Klasse W	4.539,665

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEH	13,80 ¹	13,38 ¹	14,29 ¹
Klasse AU	25,56	24,16	25,36
Klasse DEC	8,40 ¹	8,47 ¹	9,40 ¹
Klasse DEH	10,81 ¹	10,51 ¹	11,28 ¹
Klasse DU	27,82	26,43	27,85
Klasse W	54,96	51,89	54,37

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		18.143.996
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	626.376
Zinsen aus Bankguthaben	2	11.922
Zinsen aus Swapgeschäften		95.933
Zinsen aus Finanztermingeschäften		1.465
Rückerstattungen der Vermögensverwaltungsgebühr	2	3.657
Erträge insgesamt		739.353
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(166.462)
Bankspesen		(1.715)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(222.133)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(994)
Sonstige Betriebskosten	5	(52.837)
Aufwendungen insgesamt		(444.141)
Nettoertrag aus Anlagen		295.212
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		307.454
Realisierter Netto(verlust) aus Swapgeschäften		(416.784)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		391.112
Realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften		
Realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften		(354.223)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(19.281)
Realisierter Netto(verlust)		(91.722)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		479.589
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swapgeschäften		308.692
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		124.402
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Finanztermingeschäften		97.969
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		1.010.652
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		1.214.142
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		1.521.395
Anteilrücknahmen		(3.030.173)
Dividendenausschüttung	7	(12.154)
Kapitalbewegungen insgesamt		(1.520.932)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		17.837.206

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	17.837.206	18.143.996	21.893.119

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	135.822.751
Bankguthaben	2	8.246.539
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		327.486
Forderungen aus Zeichnungen		651.587
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.300.270
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	518.790
Sonstige Vermögenswerte		3.437
Summe Aktiva		146.870.860
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(2.355.022)
Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(12.200)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swapgeschäften	2, 10	(816.652)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften	2, 11	(202.704)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(52.409)
Andere Verbindlichkeiten		(16.647)
Summe Passiva		(3.455.634)
Nettovermögen insgesamt		143.415.226

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	14.279,321
Klasse AEH	2.903,311
Klasse AKH	163,000
Klasse AU	4.222,172
Klasse AUP	250,000
Klasse DEC	4.093,506
Klasse DEH	180,000
Klasse DU	9.618,855
Klasse DUP	100,000
Klasse IEH	1.275.361,000
Klasse IGH	6.844.165,341
Klasse IKH	163,000
Klasse IU	250,000
Klasse NEH	3.658,455
Klasse NGC	123.496,579
Klasse NGH	639.210,186
Klasse NU	63.188,728
Klasse ZEH	103.721,342
Klasse ZGH	62.796,645
Klasse ZU	366.911,022

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEC	10,48 ¹	10,58 ¹	10,30 ¹
Klasse AEH	10,69 ¹	10,67 ¹	10,30 ¹
Klasse AKH	106,71 ²	106,63 ²	103,10 ²
Klasse AU	11,24	10,97	10,42
Klasse AUP	10,99	10,87	10,42
Klasse DEC ⁴	9,87 ¹	—	—
Klasse DEH	10,50 ¹	10,56 ¹	10,24 ¹
Klasse DU	10,05	9,89	—
Klasse DUP ⁴	10,11	—	—
Klasse IEH	10,92 ¹	10,85 ¹	10,42 ¹
Klasse IGH	11,27 ³	11,12 ³	10,56 ³
Klasse IKH	108,80 ²	108,45 ²	104,25 ²
Klasse IU	11,45	11,14	10,53
Klasse NEH ⁴	9,85 ¹	—	—
Klasse NGC ⁴	9,84 ³	—	—
Klasse NGH ⁴	9,86 ³	—	—
Klasse NU ⁴	9,88	—	—
Klasse ZEH ⁴	9,99 ¹	—	—
Klasse ZGH	11,21 ²	11,06 ²	10,51 ²
Klasse ZU	11,40	11,10	10,49

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁴Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		26.271.321
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	3.021.340
Zinsen aus Bankguthaben	2	79.741
Zinsen aus Swapgeschäften		102.380
Zinsen aus Finanztermingeschäften		973
Erträge insgesamt		3.204.434
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(486.156)
Bankspesen		(8.429)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(453.272)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(1.404)
Sonstige Betriebskosten	5	(152.463)
Aufwendungen insgesamt		(1.101.724)
Nettoertrag aus Anlagen		2.102.710
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		1.045.273
Realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften		454.958
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		6.888.504
Realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften		231.542
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(660.240)
Realisierter Nettogewinn		7.960.037
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		1.898.648
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swapgeschäften		(708.041)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(30.076)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Finanztermingeschäften		(176.794)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		983.737
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		11.046.484
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		130.581.452
Anteilrücknahmen		(24.479.403)
Dividendenausschüttung	7	(4.628)
Kapitalbewegungen insgesamt		106.097.421
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		143.415.226

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	143.415.226	26.271.321	19.579.548

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond*

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	15.135.367
Bankguthaben	2	270.057
Forderungen aus Zeichnungen		5.783
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		105.539
Summe Aktiva		15.516.746
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(39.686)
Zahlbare Rücknahmen		(4.885)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(14.754)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften	2, 11	(11.890)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(4.588)
Andere Verbindlichkeiten		(1.258)
Summe Passiva		(77.061)
Nettovermögen insgesamt		15.439.685

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse IE	129.115,799
Klasse IEP	967.667,138
Klasse IFH	327,000
Klasse LE	331.472,175
Klasse ZE	111.139,175
Klasse ZFH	327,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018
Klasse IE [#]	10,10
Klasse IEP [#]	9,98
Klasse IFH [#]	9,98 ¹
Klasse LE [#]	10,11
Klasse ZE [#]	10,09
Klasse ZFH [#]	9,98 ¹

¹Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.[#]Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 24. Mai 2017 bis 31. März 2018

	Erläuterung	2018 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		–
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	139.206
Zinsen aus Bankguthaben	2	12
Erträge insgesamt		139.218
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(31.767)
Bankspesen		(967)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(62)
Sonstige Betriebskosten	5	(9.017)
Aufwendungen insgesamt		(41.813)
Nettoertrag aus Anlagen		97.405
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(21.868)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		13.768
Realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften		6.022
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		4.102
Realisierter Nettogewinn		2.024
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(69.069)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(14.754)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Finanztermingeschäften		(11.890)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(95.713)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		3.716
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		16.575.847
Anteilrücknahmen		(1.076.173)
Dividendenausschüttung	7	(63.705)
Kapitalbewegungen insgesamt		15.435.969
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		15.439.685

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018
EUR	15.439.685

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	81.101.218
Bankguthaben	2	3.347.727
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		120.414
Forderungen aus Zeichnungen		6.224
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		829.355
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	7.850
Sonstige Vermögenswerte		5.741
Summe Aktiva		85.418.529
Passiva		
Überziehungskredite		(203.149)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(886.837)
Zahlbare Rücknahmen		(38.209)
Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(7.139)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swapgeschäften	2, 10	(388.266)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften	2, 11	(103.938)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(62.051)
Andere Verbindlichkeiten		(14.577)
Summe Passiva		(1.704.166)
Nettovermögen insgesamt		83.714.363

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	694.243,601
Klasse AEP	337.480,099
Klasse DE	867.786,521
Klasse DEP	547.063,937
Klasse IE	1.041.547,063
Klasse W	1.580,192

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AE	28,21	27,95	27,78
Klasse AEP	15,07	15,36	15,55
Klasse DE	26,88	26,79	26,78
Klasse DEP	11,50	11,78	11,99
Klasse IE	28,00	27,58	27,25
Klasse W	59,79	59,23	58,86

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		73.018.622
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	2.486.080
Zinsen aus Bankguthaben	2	3.904
Zinsen aus Swapgeschäften		69.939
Zinsen aus Finanztermingeschäften		165
Erträge insgesamt		2.560.088
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(708.731)
Bankspesen		(18.158)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(480.529)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(3.099)
Sonstige Betriebskosten	5	(179.368)
Aufwendungen insgesamt		(1.389.885)
Nettoertrag aus Anlagen		1.170.203
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(71.224)
Realisierter Netto(verlust) aus Swapgeschäften		(770.986)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.071.352
Realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften		266.064
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(486.264)
Realisierter Nettogewinn		8.942
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(1.008.640)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swapgeschäften		362.334
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		299.778
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Finanztermingeschäften		(62.165)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(408.693)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		770.452
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		41.991.244
Anteilrücknahmen		(31.736.133)
Dividendenausschüttung	7	(329.822)
Kapitalbewegungen insgesamt		9.925.289
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		83.714.363

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
EUR	83.714.363	73.018.622	67.019.346

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	41.319.265
Bankguthaben	2	2.829.780
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		895.466
Forderungen aus Zeichnungen		62.372
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		612.733
Summe Aktiva		45.719.616
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.530.944)
Zahlbare Rücknahmen		(73.032)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(327.351)
Verbindlichkeiten aus		
Verwaltungsgebühren	5	(38.953)
Andere Verbindlichkeiten		(12.502)
Summe Passiva		(1.982.782)
Nettovermögen insgesamt		43.736.834

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	436.302,403
Klasse AEH	269.316,805
Klasse ASH	2.224,836
Klasse AU	26.148,506
Klasse AUP	916.863,731
Klasse BU	100,000
Klasse BUP	100,000
Klasse DEC	54.277,147
Klasse DEH	173.451,415
Klasse DU	71.127,768
Klasse IEH	434.533,646
Klasse W	22.807,671
Klasse WEH	7.260,489
Klasse XUP	100,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEC	13,85 ¹	14,44 ¹	14,19 ¹
Klasse AEH	20,74 ¹	20,47 ¹	19,05 ¹
Klasse ASH	13,08 ²	12,69 ²	11,64 ²
Klasse AU	20,42	19,70	18,04
Klasse AUP	8,29	8,45	8,16
Klasse BU ^f	9,85	–	–
Klasse BUP ^f	9,85	–	–
Klasse DEC	10,07 ¹	10,55 ¹	10,44 ¹
Klasse DEH	15,97 ¹	15,85 ¹	14,84 ¹
Klasse DU	15,96	15,48	14,27
Klasse IEH	28,54 ¹	27,97 ¹	25,84 ¹
Klasse P ^f	–	9,84	9,47
Klasse W	27,60	26,53	24,21
Klasse WEH	20,05 ¹	19,72 ¹	18,28 ¹
Klasse XUP	10,93	10,39	–

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.^fSiehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		37.322.884
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	2.365.207
Zinsen aus Bankguthaben	2	30.964
Zinsen aus Finanztermingeschäften		1
Erträge insgesamt		2.396.172
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(534.041)
Bankspesen		(2.931)
Sonstige Betriebskosten	5	(116.741)
Vertriebsgebühr	5	(8)
Aufwendungen insgesamt		(653.721)
Nettoertrag aus Anlagen		1.742.451
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		709.772
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		4.302.596
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(74.041)
Realisierter Nettogewinn		4.938.327
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(796.693)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(431.081)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(1.227.774)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		5.453.004
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		11.758.095
Anteilrücknahmen		(9.896.514)
Dividendenausschüttung	7	(900.635)
Kapitalbewegungen insgesamt		960.946
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		43.736.834

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	43.736.834	37.322.884	39.046.205

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	79.260.931
Bankguthaben	2	2.854.286
Forderungen aus Zeichnungen		3.178
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		967.097
Sonstige Vermögenswerte		1
Summe Aktiva		83.085.493
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.360.000)
Zahlbare Rücknahmen		(24.295)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(106.832)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(87.206)
Andere Verbindlichkeiten		(19.442)
Summe Passiva		(1.597.775)
Nettovermögen insgesamt		81.487.718

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	114.482,831
Klasse AEH	10.733,631
Klasse ASH	32.083,953
Klasse AU	85.099,078
Klasse AUP	5.451.038,228
Klasse DEH	29.067,086
Klasse DU	12.093,916
Klasse IEH	28.940,990
Klasse SU	3.381,086
Klasse SUP	129.556,208
Klasse W	22.617,049
Klasse XUP	100,000
Klasse ZU	200,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEC	10,87 ¹	11,30 ¹	10,99 ¹
Klasse AEH	26,85 ¹	26,28 ¹	24,15 ¹
Klasse ASH	12,01 ²	11,56 ²	10,46 ²
Klasse AU	73,66	70,47	63,71
Klasse AUP	12,41	12,62	12,07
Klasse DEH	20,03 ¹	19,71 ¹	18,22 ¹
Klasse DU	52,54	50,55	45,98
Klasse IEH	28,69 ¹	27,93 ¹	25,60 ¹
Klasse SU	29,72	28,47	25,77
Klasse SUP	11,98	12,20	11,69
Klasse W	60,66	57,83	52,08
Klasse XUP	11,14	10,49	–
Klasse ZU	11,54	10,96	9,84

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		92.964.757
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	5.343.355
Zinsen aus Bankguthaben	2	31.637
Zinsen aus Finanztermingeschäfte		1
Erträge insgesamt		5.374.993
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(1.203.468)
Bankspesen		(1.558)
Sonstige Betriebskosten	5	(266.907)
Aufwendungen insgesamt		(1.471.933)
Nettoertrag aus Anlagen		3.903.060
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		2.152.217
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		318.010
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(89.411)
Realisierter Nettogewinn		2.380.816
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(1.342.023)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(22.937)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(1.364.960)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		4.918.916
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		7.513.926
Anteilrücknahmen		(19.232.217)
Dividendenausschüttung	7	(4.677.664)
Kapitalbewegungen insgesamt		(16.395.955)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		81.487.718

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	81.487.718	92.964.757	109.517.844

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

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

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	124.484.525
Bankguthaben	2	8.845.522
Forderungen aus Zeichnungen		198.908
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.533.951
Sonstige Vermögenswerte		134
Summe Aktiva		135.063.040
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(2.271.000)
Zahlbare Rücknahmen		(45.619)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(710.730)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften	2, 11	(53.461)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(101.890)
Andere Verbindlichkeiten		(26.789)
Summe Passiva		(3.209.489)
Nettovermögen insgesamt		131.853.551

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	1.196.494,298
Klasse AEH	272.014,255
Klasse ASC	72.536,083
Klasse ASH	128.023,211
Klasse AU	1.969.738,793
Klasse AUP	3.994.637,131
Klasse BU	100,000
Klasse BUP	100,000
Klasse DEH	448.731,786
Klasse DU	134.440,408
Klasse IEH	1.378.408,407
Klasse W	5.174,539
Klasse ZEH	1.417.202,897

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEC	6,30 ¹	6,61 ¹	6,57 ¹
Klasse AEH	15,36 ¹	15,22 ¹	14,27 ¹
Klasse ASC	8,14 ²	8,40 ²	8,23 ²
Klasse ASH	10,91 ²	10,64 ²	9,83 ²
Klasse AU	17,34	16,82	15,52
Klasse AUP	6,23	6,40	6,27
Klasse BU [#]	9,93	–	–
Klasse BUP [#]	9,93	–	–
Klasse DEH	12,02 ¹	11,95 ¹	11,23 ¹
Klasse DU	13,56	13,18	12,19
Klasse IEH	17,15 ¹	16,90 ¹	15,75 ¹
Klasse W	20,27	19,63	18,08
Klasse ZEH	11,03 ¹	10,86 ¹	10,10 ¹

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		84.094.633
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	5.163.069
Zinsen aus Bankguthaben	2	67.669
Zinsen aus Finanztermingeschäften		187
Erträge insgesamt		5.230.925
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(986.635)
Bankspesen		(6.727)
Sonstige Betriebskosten	5	(252.394)
Vertriebsgebühr	5	(8)
Aufwendungen insgesamt		(1.245.764)
Nettoertrag aus Anlagen		3.985.161
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		796.107
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		7.886.270
Realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften		138.267
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(41.148)
Realisierter Nettogewinn		8.779.496
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(1.516.368)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(945.133)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Finanztermingeschäften		(46.711)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(2.508.212)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		10.256.445
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		64.770.847
Anteilrücknahmen		(25.604.145)
Dividendenausschüttung	7	(1.664.229)
Kapitalbewegungen insgesamt		37.502.473
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		131.853.551

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	131.853.551	84.094.633	66.713.179

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	288.920.018
Bankguthaben	2	7.080.202
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		326.249
Forderungen aus Zeichnungen		94.755
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		4.415.586
Summe Aktiva		300.836.810
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(2.320.390)
Zahlbare Rücknahmen		(166.187)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(1.543.106)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften	2, 11	(217.688)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(141.428)
Andere Verbindlichkeiten		(44.948)
Summe Passiva		(4.433.747)
Nettovermögen insgesamt		296.403.063

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	91.618,706
Klasse AEH	43.179,529
Klasse ASH	63.654,376
Klasse AU	197.319,094
Klasse AUP	483.971,655
Klasse BU	100,000
Klasse BUP	1.111,532
Klasse DEC	67.946,321
Klasse DEH	70.734,880
Klasse DU	103.367,604
Klasse IEC	93.936,000
Klasse IEH	4.310.705,739
Klasse TEH	3.423,069
Klasse XUP	1.509.043,248
Klasse ZGH	100,000
Klasse ZU	9.159.168,079

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEC	13,34 ¹	14,15 ¹	13,83 ¹
Klasse AEH	29,77 ¹	29,97 ¹	27,82 ¹
Klasse ASH	13,25 ²	13,12 ²	12,00 ²
Klasse AU	32,47	31,96	29,21
Klasse AUP	13,28	13,78	13,26
Klasse BU [‡]	9,72	–	–
Klasse BUP [‡]	9,59	–	–
Klasse DEC	10,13 ¹	10,84 ¹	10,70 ¹
Klasse DEH	21,57 ¹	21,90 ¹	20,53 ¹
Klasse DU	23,49	23,33	21,53
Klasse IEC [‡]	9,49 ¹	–	–
Klasse IEH	28,78 ¹	28,71 ¹	26,42 ¹
Klasse TEH	10,27 ¹	10,24 ¹	–
Klasse XUP	10,17	10,34	–
Klasse ZGH	10,64 ³	10,55 ³	–
Klasse ZU	11,53	11,28	10,24

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		257.452.633
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	16.260.474
Zinsen aus Bankguthaben	2	143.526
Zinsen aus Swapgeschäften		92.411
Zinsen aus Finanztermingeschäften		457
Erträge insgesamt		16.496.868
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(1.918.928)
Bankspesen		(10.734)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(42.778)
Sonstige Betriebskosten	5	(620.259)
Vertriebsgebühr	5	(33)
Aufwendungen insgesamt		(2.592.732)
Nettoertrag aus Anlagen		13.904.136
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		1.955.155
Realisierter Netto(verlust) aus Swapgeschäften		(53.950)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		17.818.852
Realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften		560.984
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(397.442)
Realisierter Nettogewinn		19.883.599
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(10.773.886)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(2.004.092)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Finanztermingeschäften		(217.688)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(12.995.666)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		20.792.069
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		138.449.197
Anteilrücknahmen		(119.296.563)
Dividendenausschüttung	7	(994.273)
Kapitalbewegungen insgesamt		18.158.361
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		296.403.063

GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
	296.403.063	257.452.633	150.840.260

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	5.816.605
Bankguthaben	2	246.892
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		19.779
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		50.079
Summe Aktiva		6.133.355
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(84.989)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(9.455)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäfte	2, 11	(9.284)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(3.098)
Andere Verbindlichkeiten		(725)
Summe Passiva		(107.551)
Nettovermögen insgesamt		6.025.804

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	455,300
Klasse AU	113.000,000
Klasse DEH	455,300
Klasse DU	99.400,000
Klasse IEC	82.805,300
Klasse IEH	455,300
Klasse IFH	493,300
Klasse IU	99.400,000
Klasse IUP	99.400,000
Klasse XUP	100,000
Klasse ZEH	455,300
Klasse ZFH	100,000
Klasse ZU	99.400,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017
Klasse AEH	9,60 ¹	9,70 ¹
Klasse AU	9,93	9,82
Klasse DEH	9,55 ¹	9,68 ¹
Klasse DU	9,88	9,80
Klasse IEC	9,29 ¹	9,66 ¹
Klasse IEH	9,70 ¹	9,74 ¹
Klasse IFH	9,63 ²	9,71 ²
Klasse IU	10,03	9,86
Klasse IUP	9,62	9,78
Klasse XUP	10,44	10,23
Klasse ZEH	9,66 ¹	9,73 ¹
Klasse ZFH ⁴	9,72 ²	–
Klasse ZU	10,00	9,84

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁴Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		16.403.928
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	513.808
Zinsen aus Bankguthaben	2	18.064
Erträge insgesamt		531.872
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(79.101)
Bankspesen		(1.187)
Sonstige Betriebskosten	5	(19.133)
Aufwendungen insgesamt		(99.421)
Nettoertrag aus Anlagen		432.451
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(2.087)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.564.689
Realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäfte		(46.723)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(49.841)
Realisierter Nettogewinn		1.466.038
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		14.126
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(59.711)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Finanztermingeschäfte		(3.300)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(48.885)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		1.849.604
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		136.982
Anteilrücknahmen		(12.016.204)
Dividendenausschüttung	7	(348.506)
Kapitalbewegungen insgesamt		(12.227.728)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		6.025.804

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017
USD	6.025.804	16.403.928

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	42.786.701
Bankguthaben	2	972.490
Termineinlagen	2, 21	5.508.414
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		2.985.480
Forderungen aus Zeichnungen		30.736
Zinsforderungen aus Swapgeschäften	2	309
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		503.765
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	85.683
Sonstige Vermögenswerte		131
Summe Aktiva		52.873.709
Passiva		
Überziehungskredite		(747.213)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(3.072.591)
Zahlbare Rücknahmen		(621)
Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(254)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swapgeschäften	2, 10	(155)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften	2, 11	(12.000)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(32.369)
Andere Verbindlichkeiten		(9.329)
Summe Passiva		(3.874.532)
Nettovermögen insgesamt		48.999.177

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	61.128,243
Klasse AS	1.243,824
Klasse ASC	1.439,021
Klasse ASH	124.062,015
Klasse AU	1.822.060,917
Klasse AUP	250,000
Klasse AVC	100,000
Klasse AVH	100,000
Klasse DEH	8.022,093
Klasse IEH	250,000
Klasse IGH	1.227.526,571
Klasse ISH	250,000
Klasse IU	250,000
Klasse XU	519.482,494
Klasse ZU	1.200,570

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEH	11,09 ¹	10,87 ¹	10,72 ¹
Klasse AS ²	9,81 ²	—	—
Klasse ASC	10,78 ²	10,80 ²	10,63 ²
Klasse ASH	11,58 ²	11,17 ²	10,87 ²
Klasse AU	11,60	11,12	10,80
Klasse AUP	10,96	10,72	10,57
Klasse AVC ³	10,31 ³	—	—
Klasse AVH ⁴	10,31 ³	—	—
Klasse DEH	10,87 ¹	10,70 ¹	10,62 ¹
Klasse IEH	11,31 ¹	11,03 ¹	10,83 ¹
Klasse IGH	11,65 ⁴	11,26 ⁴	10,95 ⁴
Klasse ISH	11,85 ²	11,37 ²	11,00 ²
Klasse IU	11,87	11,31	10,91
Klasse XU	11,00	10,39	—
Klasse ZU	11,91	11,33	10,93

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf AUD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁴Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁵Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		36.169.975
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	1.825.436
Zinsen aus Bankguthaben	2	45.936
Zinsen aus Swapgeschäften		309
Zinsen aus Finanztermingeschäften		35
Erträge insgesamt		1.871.716
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(381.369)
Bankspesen		(4.310)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(254)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(7)
Sonstige Betriebskosten	5	(101.102)
Sonstige Gebühren	4	(29.537)
Aufwendungen insgesamt		(516.579)
Nettoertrag aus Anlagen		1.355.137
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		361.506
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		3.342.080
Realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften		(42.413)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		28.536
Realisierter Nettogewinn		3.689.709
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(205.330)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swapgeschäften		(155)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(662.620)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Finanztermingeschäften		(12.000)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(880.105)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		4.164.741
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		22.779.220
Anteilrücknahmen		(14.114.116)
Dividendenausschüttung	7	(643)
Kapitalbewegungen insgesamt		8.664.461
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		48.999.177

GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
	48.999.177	36.169.975	21.789.521

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	55.833.296
Bankguthaben	2	4.418.812
Termineinlagen	2, 21	9.021.710
Forderungen aus Zeichnungen		69.186
Zinsforderungen aus Swapgeschäften	2	1.708
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		185.226
Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften	2, 11	959.299
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	2, 10	143.868
Sonstige Vermögenswerte		14.677
Summe Aktiva		70.647.782
Passiva		
Zahlbare Rücknahmen		(79.188)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(212.223)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(79.741)
Andere Verbindlichkeiten		(16.359)
Summe Passiva		(387.511)
Nettovermögen insgesamt		70.260.271

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	163.366,899
Klasse AEH	453.825,891
Klasse AU	537.502,092
Klasse AUP	739.951,607
Klasse BU	100,000
Klasse DEH	196.828,118
Klasse DU	356.151,289
Klasse IGH	45.374,717
Klasse IU	170.160,371
Klasse W	26.123,425

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEC	13,64 ¹	12,97 ¹	13,07 ¹
Klasse AEH	26,78 ¹	25,05 ¹	24,78 ¹
Klasse AU	37,42	34,21	33,29
Klasse AUP	14,70	13,66	13,54
Klasse BU ^f	10,06	–	–
Klasse DEH	19,72 ¹	18,60 ¹	18,57 ¹
Klasse DU	25,01	23,06	22,63
Klasse IGH	26,15 ²	24,09 ²	23,45 ²
Klasse IU	27,17	24,65	23,81
Klasse W	61,81	56,53	55,02

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD	
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		76.114.346	
Erträge			
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	466.554	
Zinsen aus Anleihen, netto	2	701.052	
Zinsen aus Bankguthaben	2	69.545	
Zinsen aus Swapgeschäften		84.110	
Zinsen aus Finanztermingeschäften		2.953	
Erträge insgesamt		1.324.214	
Aufwendungen			
Verwaltungsgebühren	5	(1.084.882)	
Bankspesen		(30.628)	
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(12.766)	
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(5.797)	
Sonstige Betriebskosten	5	(244.733)	
Vertriebsgebühr	5	(4)	
Aufwendungen insgesamt		(1.378.810)	
Netto(verlust) aus Anlagen		(54.596)	
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		2.857.088	
Realisierter Netto(verlust) aus Swapgeschäften		(84.094)	
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		2.403.642	
Realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften		(2.336.356)	
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		55.155	
Realisierter Netto(verlust) aus Steuerrückforderung		(20)	
Realisierter Nettogewinn		2.895.415	
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		5.388.462	
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swapgeschäften		143.868	
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(60.618)	
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Finanztermingeschäften		916.738	
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		6.388.450	
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		9.229.269	
Entwicklung des Fondsvermögens			
Zeichnungen von Anteilen		10.235.726	
Anteilrücknahmen		(25.096.503)	
Dividendenausschüttung	7	(222.567)	
Kapitalbewegungen insgesamt		(15.083.344)	
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		70.260.271	
GESAMTNETTOINVENTARWERT			
	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	70.260.271	76.114.346	84.487.072

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	290.266.296
Bankguthaben	2	12.984.458
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		534.130
Forderungen aus Zeichnungen		1.012.074
Erhaltene Vermögensverwaltungsgebühr	2	7.300
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.947.458
Sonstige Vermögenswerte		28.805
Summe Aktiva		306.780.521
Passiva		
Zum Marktwert verkaufte Optionen	2, 12	(122.854)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(4.316.548)
Zahlbare Rücknahmen		(1.030.902)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(2.642.199)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(363.949)
Andere Verbindlichkeiten		(77.905)
Summe Passiva		(8.554.357)
Nettovermögen insgesamt		298.226.164

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	100,000
Klasse AEC	9.410.348,146
Klasse AEH	2.069.974,709
Klasse AEP	578.563,575
Klasse AU	811.001,318
Klasse AUP	739.600,335
Klasse DEC	7.238.574,908
Klasse DEH	560.022,320
Klasse DEP	374.462,100
Klasse DU	516.312,980
Klasse DUP	2.164.446,695
Klasse ZE	100,000
Klasse ZEH	13.591,449
Klasse ZU	110.362,863

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AE ^f	9,50 ¹	–	–
Klasse AEC	9,22 ¹	9,54 ¹	9,55 ¹
Klasse AEH	17,26 ¹	16,80 ¹	15,79 ¹
Klasse AEP	9,32 ¹	10,85 ¹	9,96 ¹
Klasse AU	18,20	17,32	16,01
Klasse AUP	10,07	10,20	9,98
Klasse DEC	8,98 ¹	9,37 ¹	9,45 ¹
Klasse DEH ^f	10,13 ¹	–	–
Klasse DEP	9,00 ¹	10,56 ¹	9,78 ¹
Klasse DU	11,53	11,05	10,29
Klasse DUP	9,42	9,60	9,51
Klasse ZE ^f	9,54 ¹	–	–
Klasse ZEC	–	–	9,50 ¹
Klasse ZEH ^f	10,23 ¹	–	–
Klasse ZU ^f	10,45	–	–

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		107.459.495
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	3.795.039
Zinsen aus Anleihen, netto	2	3.865.266
Zinsen aus Bankguthaben	2	48.828
Zinsen aus Finanztermingeschäften		24.569
Rückerstattungen der Vermögensverwaltungsgebühr	2	7.300
Erträge insgesamt		7.741.002
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(3.100.895)
Bankspesen		(18.971)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(4.859)
Sonstige Betriebskosten	5	(596.627)
Aufwendungen insgesamt		(3.721.352)
Nettoertrag aus Anlagen		4.019.650
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		3.332.218
Realisierter Netto(verlust) aus Optionen		(1.509.659)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		8.772.655
Realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften		(25)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		1.379.410
Realisierter Netto(verlust) aus Steuerrückforderung		(14)
Realisierter Nettogewinn		11.974.585
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		5.027.565
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Optionen		378.341
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(3.282.773)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		2.123.133
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		18.117.368
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		236.164.948
Anteilrücknahmen		(52.658.059)
Dividendenausschüttung	7	(10.857.588)
Kapitalbewegungen insgesamt		172.649.301
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		298.226.164

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	298.226.164	107.459.495	43.338.714

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	449.163.010
Bankguthaben	2	2.880.173
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.796.326
Forderungen aus Zeichnungen		86.730
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		470.726
Sonstige Vermögenswerte		5.369
Summe Aktiva		454.402.334
Passiva		
Zahlbare Rücknahmen		(4.024.207)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(262.813)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(300.557)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(230.579)
Andere Verbindlichkeiten		(106.135)
Summe Passiva		(4.924.291)
Nettovermögen insgesamt		449.478.043

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	529.427,015
Klasse AEP	14.742,037
Klasse AU	584.759,183
Klasse BU	100,000
Klasse DEH	70.284,755
Klasse DU	254.038,599
Klasse IE	100,000
Klasse IU	100,000
Klasse W	23.677,468
Klasse XU	3.009.228,661
Klasse ZE	768.173,966
Klasse ZEP	3.552.220,000
Klasse ZG	628.789,100
Klasse ZU	18.798.031,450

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEH	37,45 ¹	31,94 ¹	29,87 ¹
Klasse AEP	11,37 ¹	10,99 ¹	–
Klasse AU	58,62	48,75	44,84
Klasse BU	10,36	–	–
Klasse DEH	27,65 ¹	23,75 ¹	22,38 ¹
Klasse DU	31,16	26,11	24,19
Klasse IE [#]	10,36 ¹	–	–
Klasse IU [#]	11,67	–	–
Klasse W	89,41	74,30	68,26
Klasse XU	13,23	10,82	–
Klasse ZE	11,72 ¹	11,12 ¹	–
Klasse ZEP	11,49 ¹	11,04 ¹	–
Klasse ZG	12,00 ²	11,12 ²	–
Klasse ZU	14,18	11,71	10,68

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.[#]Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		250.612.537
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	4.317.088
Zinsen aus Bankguthaben	2	78.652
Erträge insgesamt		4.395.740
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(3.350.584)
Bankspesen		(2.074)
Sonstige Betriebskosten	5	(1.328.729)
Vertriebsgebühr	5	(4)
Aufwendungen insgesamt		(4.681.391)
Netto(verlust) aus Anlagen		(285.651)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		34.347.658
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		2.875.991
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		41.963
Realisierter Netto(verlust) aus Steuerrückforderung		(470)
Realisierter Nettogewinn		37.265.142
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		33.956.993
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(346.760)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Kapitalertragsteuer		(215.973)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		33.394.260
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		70.373.751
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		320.376.379
Anteilrücknahmen		(191.294.812)
Dividendenausschüttung	7	(589.812)
Kapitalbewegungen insgesamt		128.491.755
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		449.478.043

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	449.478.043	250.612.537	57.932.423

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	4.548.101
Bankguthaben	2	26.228
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		12.436
Forderungen aus Zeichnungen		30.850
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		6.772
Sonstige Vermögenswerte	20	26.888
Summe Aktiva		4.651.275
Passiva		
Überziehungskredite		(4.291)
Zahlbare Rücknahmen		(12.828)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(8.523)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(7.573)
Andere Verbindlichkeiten		(1.087)
Summe Passiva		(34.302)
Nettovermögen insgesamt		4.616.973

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	6.745,807
Klasse AU	10.584,883
Klasse DEH	16.407,890
Klasse DU	90.392,189
Klasse IEH	5.645,579
Klasse ZU	200,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEH	33,07 ¹	28,10 ¹	26,61 ¹
Klasse AU	49,41	40,91	38,08
Klasse DEH	24,09 ¹	20,66 ¹	19,76 ¹
Klasse DU	35,36	29,56	27,79
Klasse IEH	19,41 ¹	16,37 ¹	15,37 ¹
Klasse W	–	–	35,95
Klasse ZU	11,02	9,06	8,38

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		3.965.761
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	75.650
Zinsen aus Bankguthaben	2	2.122
Erträge insgesamt		77.772
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(88.267)
Bankspesen		(60)
Sonstige Betriebskosten	5	(13.546)
Aufwendungen insgesamt		(101.873)
Netto(verlust) aus Anlagen		(24.101)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		343.459
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		86.546
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(5.685)
Realisierter Nettogewinn		424.320
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		355.621
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(10.949)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		344.672
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		744.891
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		1.818.151
Anteilrücknahmen		(1.911.830)
Kapitalbewegungen insgesamt		(93.679)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		4.616.973

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	4.616.973	3.965.761	4.287.665

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	28.567.397
Bankguthaben	2	1.183.038
Forderungen aus Zeichnungen		77.039
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		27.093
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	73.778
Sonstige Vermögenswerte		2.930
Summe Aktiva		29.931.275
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(789.539)
Zahlbare Rücknahmen		(98)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(12.454)
Andere Verbindlichkeiten		(6.760)
Summe Passiva		(808.851)
Nettovermögen insgesamt		29.122.424

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	244.554,024
Klasse AGH	67.096,273
Klasse DE	45.629,974
Klasse IE	46.420,544
Klasse IGH	261.218,273
Klasse XGH	480.296,989
Klasse ZGH	4.543,523

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AE	26,62	24,11	20,17
Klasse AGH	26,84 ¹	24,21 ¹	20,17 ¹
Klasse DE	20,61	18,76	15,78
Klasse IE	37,58	33,74	27,97
Klasse IGH	36,65 ¹	32,76 ¹	27,02 ¹
Klasse XGH	12,44 ¹	11,03 ¹	–
Klasse ZGH	26,67 ¹	23,87 ¹	19,72 ¹

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		10.636.679
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	139.962
Zinsen aus Bankguthaben	2	2.588
Erträge insgesamt		142.550
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(91.029)
Bankspesen		(323)
Sonstige Betriebskosten	5	(30.436)
Aufwendungen insgesamt		(121.788)
Nettoertrag aus Anlagen		20.762
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		469.508
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(50.461)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(11.792)
Realisierter Nettogewinn		407.255
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		1.041.813
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(120.851)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		920.962
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		1.348.979
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		18.945.247
Anteilrücknahmen		(1.808.481)
Kapitalbewegungen insgesamt		17.136.766
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		29.122.424

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
EUR	29.122.424	10.636.679	5.225.081

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	228.635.195
Bankguthaben	2	2.082.351
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.665.367
Forderungen aus Zeichnungen		141.649
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		181.913
Summe Aktiva		232.706.475
Passiva		
Zahlbare Rücknahmen		(2.117.015)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(346.639)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(220.159)
Andere Verbindlichkeiten		(54.800)
Summe Passiva		(2.738.613)
Nettovermögen insgesamt		229.967.862

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	108.541,591
Klasse AU	1.207.454,205
Klasse BU	100,000
Klasse DEH	74.259,976
Klasse DU	865.067,177
Klasse IEH	510.117,218
Klasse IU	1.951.500,617
Klasse W	1.742,035

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEH	42,33 ¹	37,41 ¹	33,06 ¹
Klasse AU	68,00	58,72	51,12
Klasse BU ^f	10,11	–	–
Klasse DEH	31,68 ¹	28,11 ¹	24,97 ¹
Klasse DU	26,73	23,19	20,29
Klasse IEH	44,45 ¹	38,94 ¹	34,09 ¹
Klasse IU	45,17	38,64	33,33
Klasse W	89,67	77,16	66,93

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		192.184.138
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.347.496
Zinsen aus Bankguthaben	2	27.144
Erträge insgesamt		2.374.640
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(2.448.996)
Bankspesen		(5.309)
Sonstige Betriebskosten	5	(572.501)
Vertriebsgebühr	5	(4)
Aufwendungen insgesamt		(3.026.810)
Netto(verlust) aus Anlagen		(652.170)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		29.667.162
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		5.478.942
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(12.211)
Realisierter Nettogewinn		35.133.893
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		1.493.116
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(482.100)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		1.011.016
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		35.492.739
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		128.433.585
Anteilrücknahmen		(126.142.600)
Kapitalbewegungen insgesamt		2.290.985
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		229.967.862

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	229.967.862	192.184.138	196.693.655

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Select

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	9.294.371
Bankguthaben	2	16.237
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		93.786
Forderungen aus Zeichnungen		2.174
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		4.110
Summe Aktiva		9.410.678
Passiva		
Zahlbare Rücknahmen		(29.231)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(11.561)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(13.786)
Andere Verbindlichkeiten		(2.317)
Summe Passiva		(56.895)
Nettovermögen insgesamt		9.353.783

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	23.330,759
Klasse AU	167.259,298
Klasse DEH	14.084,236
Klasse DU	171.742,657
Klasse IEH	3.701,160
Klasse W	26.121,323

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEH	27,28 ¹	24,33 ¹	20,84 ¹
Klasse AU	23,20	20,20	17,05
Klasse DEH	19,09 ¹	17,15 ¹	14,80 ¹
Klasse DU	20,92	18,35	15,60
Klasse IEH	28,27 ¹	25,01 ¹	21,26 ¹
Klasse W	24,50	21,31	17,97
Klasse ZFH	–	–	15,47 ²

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		5.368.628
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	70.292
Zinsen aus Bankguthaben	2	2.663
Erträge insgesamt		72.955
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(134.379)
Bankspesen		(1)
Sonstige Betriebskosten	5	(25.946)
Aufwendungen insgesamt		(160.326)
Netto(verlust) aus Anlagen		(87.371)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		908.865
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		92.240
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		3.784
Realisierter Nettogewinn		1.004.889
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		94.752
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(14.035)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		80.717
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		998.235
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		5.206.421
Anteilrücknahmen		(2.219.501)
Kapitalbewegungen insgesamt		2.986.920
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		9.353.783

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	9.353.783	5.368.628	6.035.001

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	181.340.763
Bankguthaben	2	9.805.598
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		699.381
Forderungen aus Zeichnungen		635.623
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		409.455
Sonstige Vermögenswerte	20	1.797.975
Summe Aktiva		194.688.795
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(3.697.383)
Zahlbare Rücknahmen		(1.643)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(3.572)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(47.031)
Andere Verbindlichkeiten		(32.309)
Summe Passiva		(3.781.938)
Nettovermögen insgesamt		190.906.857

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	100,000
Klasse AF	100,000
Klasse AS	100,000
Klasse ASH	61.414,537
Klasse AU	12.470,902
Klasse DE	137,250
Klasse IE	40.017,501
Klasse IF	100,000
Klasse ISH	630,000
Klasse IU	19.717,724
Klasse XUP	8.353.665,171
Klasse ZE	422.479,000
Klasse ZEH	360,000
Klasse ZF	100,000
Klasse ZU	4.366.400,893

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AE	13,78 ¹	12,54 ¹	10,20 ¹
Klasse AF	14,97 ²	12,38 ²	10,27 ²
Klasse AS ³	11,02 ³	–	–
Klasse ASH	14,60 ³	11,69 ³	10,17 ³
Klasse AU	14,80	11,69	10,14
Klasse DE	13,44 ¹	12,35 ¹	10,15 ¹
Klasse IE	14,03 ¹	12,67 ¹	10,24 ¹
Klasse IF	15,23 ²	12,51 ²	10,31 ²
Klasse ISH	15,05 ³	11,93 ³	10,31 ³
Klasse IU	15,21	11,95	10,28
Klasse XUP	13,80	10,97	–
Klasse ZE	14,05 ¹	12,69 ¹	10,25 ¹
Klasse ZEH	14,55 ¹	11,73 ¹	10,27 ¹
Klasse ZF	15,25 ²	12,52 ²	10,31 ²
Klasse ZU	15,21	11,95	10,28

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		76.875.913
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.991.957
Zinsen aus Bankguthaben	2	47.046
Erträge insgesamt		3.039.003
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(477.934)
Bankspesen		(1.774)
Sonstige Betriebskosten	5	(349.805)
Aufwendungen insgesamt		(829.513)
Nettoertrag aus Anlagen		2.209.490
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		19.603.771
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		28.184
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(216.518)
Realisierter Nettogewinn		19.415.437
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		13.328.666
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(13.571)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		13.315.095
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		34.940.022
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		102.254.620
Anteilrücknahmen		(21.204.987)
Dividendenausschüttung	7	(1.958.711)
Kapitalbewegungen insgesamt		79.090.922
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		190.906.857

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	190.906.857	76.875.913	6.423.002

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asian Focus

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	6.198.578
Bankguthaben	2	278.509
Forderungen aus Zeichnungen		7.626
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		24.759
Sonstige Vermögenswerte	20	60.273
Summe Aktiva		6.569.745
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(72.551)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(426)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(4.663)
Andere Verbindlichkeiten		(1.203)
Summe Passiva		(78.843)
Nettovermögen insgesamt		6.490.902

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	100,000
Klasse AF	100,000
Klasse AS	100,000
Klasse ASH	44.109,951
Klasse AU	4.973,570
Klasse DE	100,000
Klasse DEH	360,000
Klasse IE	100,000
Klasse IF	100,000
Klasse ISH	630,000
Klasse IU	372.121,891
Klasse XUP	100,000
Klasse ZE	100,000
Klasse ZEH	360,000
Klasse ZF	100,000
Klasse ZU	6.713,753

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AE	14,08 ¹	12,47 ¹	10,20 ¹
Klasse AF	15,18 ²	12,22 ²	10,18 ²
Klasse AS ³	11,05 ³	–	–
Klasse ASH	14,95 ³	11,62 ³	10,16 ³
Klasse AU	15,06	11,60	10,11
Klasse DE	13,74 ¹	12,28 ¹	10,15 ¹
Klasse DEH	13,89 ¹	11,07 ¹	9,92 ¹
Klasse IE	14,33 ¹	12,60 ¹	10,23 ¹
Klasse IF	15,45 ²	12,34 ²	10,22 ²
Klasse ISH	15,39 ³	11,87 ³	10,31 ³
Klasse IU	15,52	11,86	10,26
Klasse XUP	14,75	11,18	–
Klasse ZE	14,35 ¹	12,62 ¹	10,24 ¹
Klasse ZEH	14,86 ¹	11,65 ¹	10,25 ¹
Klasse ZF	15,47 ²	12,36 ²	10,22 ²
Klasse ZU	15,51	11,86	10,25

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

*Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		6.686.198
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	136.172
Zinsen aus Bankguthaben	2	2.423
Erträge insgesamt		138.595
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(69.538)
Bankspesen		(183)
Sonstige Betriebskosten	5	(19.609)
Aufwendungen insgesamt		(89.330)
Nettoertrag aus Anlagen		49.265
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		1.684.334
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		27.868
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(5.123)
Realisierter Nettogewinn		1.707.079
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		392.516
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(4.140)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		388.376
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		2.144.720
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		991.739
Anteilrücknahmen		(3.331.755)
Kapitalbewegungen insgesamt		(2.340.016)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		6.490.902

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	6.490.902	6.686.198	5.901.015

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	21.797.047
Bankguthaben	2	333.160
Forderungen aus Zeichnungen		332.929
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		7.936
Sonstige Vermögenswerte	20	245.470
Summe Aktiva		22.716.542
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(178.179)
Zahlbare Rücknahmen		(143.842)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(99.949)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(27.744)
Andere Verbindlichkeiten		(5.606)
Summe Passiva		(455.320)
Nettovermögen insgesamt		22.261.222

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	100,000
Klasse AEP	100,000
Klasse AF	100,000
Klasse AFP	100,000
Klasse ASC	1.279.352,358
Klasse ASH	256.954,875
Klasse ASP	100,000
Klasse AU	121.258,699
Klasse AUP	196.937,763
Klasse AVC	118.158,256
Klasse AVH	196.595,576
Klasse DE	100,000
Klasse IE	100,000
Klasse IEP	100,000
Klasse IF	100,000
Klasse IFP	100,000
Klasse ISH	630,000
Klasse IU	99,997
Klasse IUP	100,000
Klasse ZE	100,000
Klasse ZEH	31.950,021
Klasse ZEP	100,000
Klasse ZF	100,000
Klasse ZFP	100,000
Klasse ZU	12.519,061
Klasse ZUP	100,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		25.597.056
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	624.772
Zinsen aus Bankguthaben	2	7.105
Erträge insgesamt		631.877
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(320.510)
Bankspesen		(1.389)
Sonstige Betriebskosten	5	(73.881)
Aufwendungen insgesamt		(395.780)
Nettoertrag aus Anlagen		236.097
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		3.799.692
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.133.279
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(13.416)
Realisierter Nettogewinn		4.919.555
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		665.453
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(330.538)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		334.915
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		5.490.567
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		10.293.391
Anteilrücknahmen		(18.610.660)
Dividendenausschüttung	7	(509.132)
Kapitalbewegungen insgesamt		(8.826.401)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		22.261.222

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	22.261.222	25.597.056	33.956.561

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AE	13,00 ¹	12,01 ¹	10,23 ¹
Klasse AEP	13,00 ¹	12,01 ¹	10,23 ¹
Klasse AF	14,02 ²	11,77 ²	10,22 ²
Klasse AFP	14,02 ²	11,77 ²	10,22 ²
Klasse ASC	11,96 ³	10,02 ³	9,49 ³
Klasse ASH	13,70 ³	11,11 ³	10,13 ³
Klasse ASP ^f	11,13 ³	–	–
Klasse AU	13,97	11,22	10,18
Klasse AUP	12,27	10,20	9,60
Klasse AVC	11,86 ⁴	9,88 ⁴	9,31 ⁴
Klasse AVH	13,11 ⁴	10,55 ⁴	9,57 ⁴
Klasse DE	12,68 ¹	11,83 ¹	10,17 ¹
Klasse IE	13,23 ¹	12,13 ¹	10,26 ¹
Klasse IEP	13,23 ¹	12,13 ¹	10,26 ¹
Klasse IF	14,27 ²	11,89 ²	10,26 ²
Klasse IFP	14,27 ²	11,89 ²	10,26 ²
Klasse ISH	14,12 ³	11,36 ³	10,28 ³
Klasse IU	14,39	11,47	10,33
Klasse IUP	14,60	11,64	10,55
Klasse ZE	13,25 ¹	12,15 ¹	10,27 ¹
Klasse ZEH	13,65 ¹	11,15 ¹	10,23 ¹
Klasse ZEP	13,25 ¹	12,15 ¹	10,27 ¹
Klasse ZF	14,29 ²	11,91 ²	10,26 ²
Klasse ZFP	14,29 ²	11,91 ²	10,26 ²
Klasse ZU	14,39	11,47	10,33
Klasse ZUP	14,62	11,66	10,49

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

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

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

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

^fSiehe Erläuterung 1.

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	972.197.532
Bankguthaben	2	30.833.433
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		948.738
Forderungen aus Zeichnungen		3.406.766
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		805.216
Summe Aktiva		1.008.191.685
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.492.243)
Zahlbare Rücknahmen		(6.478.245)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(384.296)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(552.952)
Andere Verbindlichkeiten		(221.033)
Summe Passiva		(9.128.769)
Nettovermögen insgesamt		999.062.916

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	2.023,878
Klasse AEH	12.436,761
Klasse AU	4.958.895,038
Klasse AUP	9.237,738
Klasse DU	5.004,677
Klasse IU	5.771.579,901
Klasse XS	2.397.351,152
Klasse XSH	31.375.505,959
Klasse ZEH	1.586.328,000
Klasse ZFH	200,000
Klasse ZGH	200,000
Klasse ZU	18.217.704,199

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEC	12,75 ¹	12,13 ¹	10,90 ¹
Klasse AEH	19,80 ¹	18,54 ¹	16,57 ¹
Klasse ASH ²	–	14,13 ²	12,46 ²
Klasse AU	33,62	30,73	27,05
Klasse AUP	13,03	12,11	10,86
Klasse DEH	–	–	14,22 ¹
Klasse DU	17,04	15,65	13,85
Klasse IFH ³	–	28,97 ³	25,83 ³
Klasse IU	47,16	42,76	37,35
Klasse XS	10,75 ²	10,28 ²	–
Klasse XSH	11,57 ²	10,47 ²	–
Klasse ZEH	12,56 ¹	11,66 ¹	10,35 ¹
Klasse ZFH	12,39 ³	11,54 ³	10,29 ³
Klasse ZGH	12,83 ⁴	11,81 ⁴	10,41 ⁴
Klasse ZU	13,10	11,88	10,38

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁴Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁵Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		1.100.856.010
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	14.487.645
Zinsen aus Bankguthaben	2	308.129
Erträge insgesamt		14.795.774
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(7.376.329)
Bankspesen		(24.020)
Sonstige Betriebskosten	5	(2.840.129)
Aufwendungen insgesamt		(10.240.478)
Nettoertrag aus Anlagen		4.555.296
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		75.714.409
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		23.850.255
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(785.878)
Realisierter Nettogewinn		98.778.786
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		36.480.695
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(678.519)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		35.802.176
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		139.136.258
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		802.991.349
Anteilrücknahmen		(1.043.918.236)
Dividendenausschüttung	7	(2.465)
Kapitalbewegungen insgesamt		(240.929.352)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		999.062.916

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	999.062.916	1.100.856.010	700.588.642

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities*

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	5.598.045
Bankguthaben	2	51.133
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		176.755
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		6.693
Summe Aktiva		5.832.626
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(187.056)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(174)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(2.195)
Andere Verbindlichkeiten		(641)
Summe Passiva		(190.066)
Nettovermögen insgesamt		5.642.560

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	175,100
Klasse AEH	175,100
Klasse AU	99.600,000
Klasse AUP	99.600,000
Klasse DE	175,100
Klasse DEH	175,100
Klasse DU	99.600,000
Klasse IE	175,100
Klasse IEC	175,100
Klasse IEH	175,100
Klasse IFH	161,100
Klasse IU	99.600,000
Klasse ZEH	175,100
Klasse ZFH	161,100
Klasse ZU	99.600,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

31. März 2018

Klasse AE ¹	10,25 ¹
Klasse AEH ¹	11,10 ¹
Klasse AU ¹	11,31
Klasse AUP ¹	11,15
Klasse DE ¹	10,24 ¹
Klasse DEH ¹	11,08 ¹
Klasse DU ¹	11,29
Klasse IE ¹	10,28 ¹
Klasse IEC ¹	10,97 ¹
Klasse IEH ¹	11,13 ¹
Klasse IFH ¹	11,10 ²
Klasse IU ¹	11,34
Klasse ZEH ¹	11,12 ¹
Klasse ZFH ¹	11,09 ²
Klasse ZU ¹	11,33

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 16. Juni 2017 bis 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		–
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	58.235
Zinsen aus Bankguthaben	2	78
Erträge insgesamt		58.313
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(20.479)
Bankspesen		(2)
Sonstige Betriebskosten	5	(5.979)
Aufwendungen insgesamt		(26.460)
Nettoertrag aus Anlagen		31.853
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		138.715
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.022
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(32)
Realisierter Nettogewinn		139.705
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		487.721
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(174)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		487.547
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		659.105
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		4.998.924
Dividendenausschüttung	7	(15.469)
Kapitalbewegungen insgesamt		4.983.455
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		5.642.560

GESAMTNETTOINVENTARWERT

31. März 2018

USD 5.642.560

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	64.303.665
Bankguthaben	2	565.473
Forderungen aus Zeichnungen		5.969
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		143.612
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	69.238
Sonstige Vermögenswerte		97.803
Summe Aktiva		65.185.760
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(423.669)
Zahlbare Rücknahmen		(42.343)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(40.042)
Andere Verbindlichkeiten		(11.795)
Summe Passiva		(517.849)
Nettovermögen insgesamt		64.667.911

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	227.928,900
Klasse ASH	567.503,106
Klasse AUH	136.397,842
Klasse BUH	100,000
Klasse DE	254.278,711
Klasse IE	133.186,894
Klasse W	47.462,720
Klasse XE	642.408,524
Klasse ZUH	200,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AE	59,61	59,30	53,98
Klasse ASH	16,39 ¹	16,08 ¹	14,44 ¹
Klasse AUH	19,17 ²	18,72 ²	16,79 ²
Klasse BUH ^f	9,43 ²	–	–
Klasse DE	21,74	21,77	19,96
Klasse IE	40,97	40,41	36,48
Klasse W	50,04	49,73	45,22
Klasse XE	46,43	45,41	40,64
Klasse ZUH	12,23 ²	11,85 ²	10,55 ²

¹Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.²Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.^fSiehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		78.602.505
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.507.599
Zinsen aus Bankguthaben	2	24
Erträge insgesamt		1.507.623
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(620.378)
Bankspesen		(2.174)
Sonstige Betriebskosten	5	(176.988)
Vertriebsgebühr		(3)
Aufwendungen insgesamt		(799.543)
Nettoertrag aus Anlagen		708.080
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		3.938.800
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(865.890)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(16.985)
Realisierter Nettogewinn		3.055.925
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(3.504.518)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		7.066
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(3.497.452)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		266.553
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		13.563.372
Anteilrücknahmen		(27.764.519)
Kapitalbewegungen insgesamt		(14.201.147)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		64.667.911

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
EUR	64.667.911	78.602.505	123.307.428

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	515.663.002
Bankguthaben	2	2.144.320
Termineinlagen	2, 21	5.699.575
Forderungen aus Zeichnungen		4.028.169
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		395.803
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	112.097
Sonstige Vermögenswerte		286.289
Summe Aktiva		528.329.255
Passiva		
Zahlbare Rücknahmen		(806.975)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(537.094)
Andere Verbindlichkeiten		(128.713)
Summe Passiva		(1.472.782)
Nettovermögen insgesamt		526.856.473

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	6.293.122,405
Klasse ASH	875.177,380
Klasse DE	1.369.923,412
Klasse IE	4.884.053,884
Klasse W	14.265,403

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AE	37,79	33,67	29,77
Klasse ASH	24,75 ¹	21,74 ¹	18,98 ¹
Klasse DE	35,01	31,48	28,08
Klasse IE	46,42	41,06	36,03
Klasse W	63,31	56,44	49,93

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		348.433.103
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	7.103.296
Erträge insgesamt		7.103.296
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(5.723.310)
Bankspesen		(47.998)
Sonstige Betriebskosten	5	(1.358.170)
Aufwendungen insgesamt		(7.129.478)
Netto(verlust) aus Anlagen		(26.182)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		13.815.034
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(707.389)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		37.262
Realisierter Nettogewinn		13.144.907
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		32.500.584
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		40.984
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		32.541.568
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		45.660.293
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		260.471.883
Anteilrücknahmen		(127.708.806)
Kapitalbewegungen insgesamt		132.763.077
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		526.856.473

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
EUR	526.856.473	348.433.103	301.865.609

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Select

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	32.627.927
Bankguthaben	2	29.119
Forderungen aus Zeichnungen		42.392
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		45.380
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	333.889
Sonstige Vermögenswerte		52.166
Summe Aktiva		33.130.873
Passiva		
Zahlbare Rücknahmen		(164.105)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(20.652)
Andere Verbindlichkeiten		(7.509)
Summe Passiva		(192.266)
Nettovermögen insgesamt		32.938.607

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	37.176,666
Klasse AGH	1.573,795
Klasse AUH	31.379,677
Klasse IE	174.925,345
Klasse ZG	3.422,125
Klasse ZGH	1.012.412,813

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AE	21,54	20,67	18,83
Klasse AGH	22,60 ¹	21,47 ¹	19,32 ¹
Klasse AUH	22,72 ²	21,30 ²	19,01 ²
Klasse IE	30,26	28,78	25,98
Klasse ZG ³	10,51 ¹	–	–
Klasse ZGH	22,67 ¹	21,47 ¹	19,26 ¹

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 EUR	
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		109.681.600	
Erträge			
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.761.695	
Zinsen aus Bankguthaben		19.802	
Erträge insgesamt		1.781.497	
Aufwendungen			
Verwaltungsgebühren	5	(608.090)	
Bankspesen		(6.420)	
Sonstige Betriebskosten	5	(234.740)	
Aufwendungen insgesamt		(849.250)	
Nettoertrag aus Anlagen		932.247	
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		9.427.350	
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(1.245.992)	
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		20.399	
Realisierter Nettogewinn		8.201.757	
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(3.788.567)	
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(2.153.975)	
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(5.942.542)	
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		3.191.462	
Entwicklung des Fondsvermögens			
Zeichnungen von Anteilen		9.968.077	
Anteilrücknahmen		(89.902.532)	
Kapitalbewegungen insgesamt		(79.934.455)	
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		32.938.607	
GESAMTNETTOINVENTARWERT			
EUR	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
	32.938.607	109.681.600	9.210.792

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	51.109.328
Bankguthaben	2	1.271.578
Forderungen aus Zeichnungen		10.037
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		186.960
Sonstige Vermögenswerte	20	545.491
Summe Aktiva		53.123.394
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(515.134)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(8.897)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(59.969)
Andere Verbindlichkeiten		(12.342)
Summe Passiva		(596.342)
Nettovermögen insgesamt		52.527.052

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	11.698,140
Klasse AU	502.024,189
Klasse AUP	100,000
Klasse DEH	14.290,485
Klasse DU	18.755,631
Klasse DUP	100,000
Klasse IEP	100,000
Klasse W	37.593,768
Klasse ZGH	6.891,198
Klasse ZUP	272.410,497

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEH	38,19 ¹	31,80 ¹	28,49 ¹
Klasse AU	88,46	71,86	63,23
Klasse AUP [#]	12,29	–	–
Klasse DEH	27,78 ¹	23,36 ¹	21,13 ¹
Klasse DU	44,05	36,12	32,10
Klasse DUP [#]	12,18	–	–
Klasse IEP [#]	10,99 ¹	–	–
Klasse W	65,90	53,62	47,25
Klasse ZGH	20,74 ²	17,02 ²	15,03 ²
Klasse ZUP	13,69	11,42	–

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.[#]Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		39.058.331
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.537.962
Zinsen aus Bankguthaben	2	7.006
Erträge insgesamt		1.544.968
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(665.335)
Bankspesen		(211)
Sonstige Betriebskosten	5	(151.857)
Aufwendungen insgesamt		(817.403)
Nettoertrag aus Anlagen		727.565
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		4.658.378
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		81.403
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(40.307)
Realisierter Nettogewinn		4.699.474
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		3.608.658
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(13.119)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Kapitalertragssteuer		19.566
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		3.615.105
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		9.042.144
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		8.974.937
Anteilrücknahmen		(4.479.228)
Dividendenausschüttung	7	(69.132)
Kapitalbewegungen insgesamt		4.426.577
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		52.527.052

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	52.527.052	39.058.331	35.404.166

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Greater China Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	3.789.872
Bankguthaben	2	85.235
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		135.795
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		579
Sonstige Vermögenswerte	20	33.387
Summe Aktiva		4.044.868
Passiva		
Zahlbare Rücknahmen		(195.562)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(9.891)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(6.192)
Andere Verbindlichkeiten		(2.028)
Summe Passiva		(213.673)
Nettovermögen insgesamt		3.831.195

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	12.425,809
Klasse AU	21.277,962
Klasse DEH	7.074,134
Klasse DU	23.145,305
Klasse W	1.532,219

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEH	46,27 ¹	33,69 ¹	29,09 ¹
Klasse AU	71,76	50,91	43,23
Klasse DEH	33,60 ¹	24,70 ¹	21,54 ¹
Klasse DU	51,63	36,99	31,73
Klasse W	65,98	46,88	39,86

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		3.136.167
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	84.336
Zinsen aus Bankguthaben	2	70
Erträge insgesamt		84.406
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(80.001)
Bankspesen		(83)
Sonstige Betriebskosten	5	(14.830)
Aufwendungen insgesamt		(94.914)
Netto(verlust) aus Anlagen		(10.508)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		704.637
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		117.972
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(394)
Realisierter Nettogewinn		822.215
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		704.146
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(12.103)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		692.043
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		1.503.750
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		2.266.372
Anteilrücknahmen		(3.075.094)
Kapitalbewegungen insgesamt		(808.722)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		3.831.195

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	3.831.195	3.136.167	3.890.625

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Energy Equities*

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2017 bis 17. Januar 2018

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		19.375.565
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	384.281
Zinsen aus Bankguthaben	2	2.325
Erträge insgesamt		386.606
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(244.146)
Bankspesen		(18)
Sonstige Betriebskosten	5	(49.095)
Aufwendungen insgesamt		(293.259)
Nettoertrag aus Anlagen		93.347
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		845.811
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		593.314
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		867
Realisierter Nettogewinn		1.439.992
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		1.051.621
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(23.935)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		1.027.686
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		2.561.025
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		2.845.930
Anteiltrücknahmen		(24.782.520)
Kapitalbewegungen insgesamt		(21.936.590)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		–

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	17. Januar 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	–	19.375.565	25.172.595

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	17. Januar 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEH [#]	–	20,94 ¹	19,03 ¹
Klasse AU [#]	–	28,84	25,79
Klasse DEH [#]	–	15,68 ¹	14,34 ¹
Klasse DU [#]	–	21,41	19,26
Klasse W [#]	–	34,32	30,61

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

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	202.380.975
Bankguthaben	2	2.127.952
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		16.319
Forderungen aus Zeichnungen		1.170.775
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		96.075
Sonstige Vermögenswerte		3.715
Summe Aktiva		205.795.811
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(353.871)
Zahlbare Rücknahmen		(501.076)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(220.051)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(261.887)
Andere Verbindlichkeiten		(49.116)
Summe Passiva		(1.386.001)
Nettovermögen insgesamt		204.409.810

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	508.002,125
Klasse AS	698.872,807
Klasse AU	2.833.637,723
Klasse BU	83.018,997
Klasse DU	378.795,740
Klasse IEH	236.517,337
Klasse ZFH	100,000
Klasse ZU	1.244.892,177

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEH	34,92 ¹	29,09 ¹	22,94 ¹
Klasse AS ²	10,82 ²	–	–
Klasse AU	42,79	34,75	27,02
Klasse BU	54,88	44,74	34,89
Klasse DU	63,63	51,86	40,45
Klasse IEH ³	11,45 ¹	–	–
Klasse ZFH ³	11,21 ³	–	–
Klasse ZU	18,96	15,28	11,78

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		95.382.949
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	985.094
Zinsen aus Bankguthaben	2	62.194
Erträge insgesamt		1.047.288
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(2.434.997)
Bankspesen		(340)
Sonstige Betriebskosten	5	(510.399)
Aufwendungen insgesamt		(2.945.736)
Netto(verlust) aus Anlagen		(1.898.448)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		13.447.786
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		934.676
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(95.608)
Realisierter Nettogewinn		14.286.854
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		16.217.384
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(222.291)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		15.995.093
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		28.383.499
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		157.591.370
Anteilrücknahmen		(76.948.008)
Kapitalbewegungen insgesamt		80.643.362
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		204.409.810

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	204.409.810	95.382.949	27.982.645

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Mondrian Investment Partners - Emerging Markets Equity

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	194.504.741
Bankguthaben	2	2.637.748
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.011.335
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.022.889
Sonstige Vermögenswerte	20	1.645.549
Summe Aktiva		200.822.262
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(889.829)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(151.389)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(211.162)
Andere Verbindlichkeiten		(62.283)
Summe Passiva		(1.314.663)
Nettovermögen insgesamt		199.507.599

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse M 4.852.527,333

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse M	41,11	36,03	31,89

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		229.552.658
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	8.244.937
Zinsen aus Bankguthaben	2	54.491
Provision für Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen	5	536.880
Erträge insgesamt		8.836.308
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(2.260.108)
Bankspesen		(310)
Sonstige Betriebskosten	5	(475.812)
Depot- und Unterdepotgebühren	5	(111.633)
Aufwendungen insgesamt		(2.847.863)
Nettoertrag aus Anlagen		5.988.445
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		9.861.465
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(220.828)
Realisierter Netto(verlust) aus Steuerrückforderung		2.970
Realisierter Nettogewinn		9.643.607
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		18.757.767
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Kapitalertragssteuer		166.192
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		18.923.959
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		34.556.011
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		24.875.000
Anteilrücknahmen		(89.476.070)
Kapitalbewegungen insgesamt		(64.601.070)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		199.507.599

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	199.507.599	229.552.658	214.832.904

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - UK Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 GBP
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	144.996.065
Bankguthaben	2	11.437
Forderungen aus Zeichnungen		536.178
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		849.363
Sonstige Vermögenswerte		42
Summe Aktiva		146.393.085
Passiva		
Überziehungskredite		(558.287)
Zahlbare Rücknahmen		(249.957)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(128.033)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(102.306)
Andere Verbindlichkeiten		(30.378)
Summe Passiva		(1.068.961)
Nettovermögen insgesamt		145.324.124

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	87.191,343
Klasse AFH	100,000
Klasse AG	247.515,768
Klasse AGP	551.015,977
Klasse DEH	100,000
Klasse DG	100,000
Klasse IEH	259.157,544
Klasse IG	648.918,449
Klasse IGP	1.474.101,471
Klasse ZEH	122.783,050
Klasse ZFH	9.239,929
Klasse ZG	1.452.109,940
Klasse ZGP	656.798,682
Klasse ZUH	219.623,924

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEH	19,65 ¹	20,12 ¹	17,40 ¹
Klasse AFH ^f	9,65 ²	–	–
Klasse AG	26,70	27,07	23,16
Klasse AGP	22,39	23,46	20,70
Klasse DEH ^f	9,57 ¹	–	–
Klasse DG ^f	9,63	–	–
Klasse IEH	28,64 ¹	29,03 ¹	24,92 ¹
Klasse IG	37,57	37,72	31,96
Klasse IGP	31,71	32,96	28,73
Klasse ZEH	11,83 ¹	12,02 ¹	10,33 ¹
Klasse ZFH	11,53 ²	11,76 ²	10,16 ²
Klasse ZG	25,11	25,27	21,45
Klasse ZGP	11,46	11,94	10,34
Klasse ZUH	12,09 ³	12,02 ³	10,17 ³

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 GBP
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		177.585.100
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	5.514.067
Zinsen aus Bankguthaben	2	5.950
Erträge insgesamt		5.520.017
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(1.481.816)
Bankspesen		(421)
Sonstige Betriebskosten	5	(450.514)
Aufwendungen insgesamt		(1.932.751)
Nettoertrag aus Anlagen		3.587.266
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		15.599.968
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(549.028)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(37.550)
Realisierter Nettogewinn		15.013.390
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(20.253.766)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		680.083
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(19.573.683)
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(973.027)
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		82.128.916
Anteilrücknahmen		(111.277.013)
Dividendenausschüttung	7	(2.139.852)
Kapitalbewegungen insgesamt		(31.287.949)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		145.324.124

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
GBP	145.324.124	177.585.100	98.246.818

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) -UK Equity Income

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 GBP
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	77.027.129
Bankguthaben	2	2.742.212
Forderungen aus Zeichnungen		316.928
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		212.540
Summe Aktiva		80.298.809
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.576.334)
Zahlbare Rücknahmen		(192.466)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(6.511)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(33.416)
Andere Verbindlichkeiten		(12.504)
Summe Passiva		(1.821.231)
Nettovermögen insgesamt		78.477.578

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	114,600
Klasse AEC	114,600
Klasse AEH	114,600
Klasse AG	100,000
Klasse ASC	175,600
Klasse AUC	128,700
Klasse DE	7.426,972
Klasse DEC	114,600
Klasse DEH	114,600
Klasse DG	786,076
Klasse DGP	100,000
Klasse IE	257.446,463
Klasse IEH	26.642,358
Klasse IG	205.949,170
Klasse IGP	1.271.339,943
Klasse IU	19.576,301
Klasse IUH	100,000
Klasse LG	1.306.624,908
Klasse LGP	4.849.262,650
Klasse ZE	114,600
Klasse ZEH	114,600
Klasse ZFH	12.494,172
Klasse ZG	100,000
Klasse ZGP	100,000
Klasse ZUH	81.256,749

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 GBP
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		56.974.541
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.645.151
Zinsen aus Bankguthaben	2	4.539
Erträge insgesamt		2.649.690
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(365.869)
Sonstige Betriebskosten	5	(137.904)
Aufwendungen insgesamt		(503.773)
Nettoertrag aus Anlagen		2.145.917
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		332.763
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(89.314)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(42.891)
Realisierter Nettogewinn		200.558
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(4.910.404)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		31.080
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(4.879.324)
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(2.532.849)
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		41.872.302
Anteilrücknahmen		(15.864.586)
Dividendenausschüttung	7	(1.971.830)
Kapitalbewegungen insgesamt		24.035.886
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		78.477.578

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017
GBP	78.477.578	56.974.541

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017
Klasse AE	10,03 ¹	10,62 ¹
Klasse AEC	9,61 ¹	10,25 ¹
Klasse AEH	9,82 ¹	10,25 ¹
Klasse AG	9,99	10,34
Klasse ASC	9,91 ²	10,33 ²
Klasse AUC	9,94 ³	10,35 ³
Klasse DE	9,91 ¹	10,59 ¹
Klasse DEC	9,50 ¹	10,22 ¹
Klasse DEH	9,71 ¹	10,22 ¹
Klasse DG	9,89	10,30
Klasse DGP	9,89	10,30
Klasse IE	10,16 ¹	10,67 ¹
Klasse IEH	9,96 ¹	10,31 ¹
Klasse IG	10,15	10,39
Klasse IGP	9,74	10,35
Klasse IU	11,16 ³	10,19 ³
Klasse IUH ⁴	9,78 ³	–
Klasse LG	10,17	10,40
Klasse LGP	9,73	10,34
Klasse ZE	10,14 ¹	10,66 ¹
Klasse ZEH	9,93 ¹	10,29 ¹
Klasse ZFH	9,87 ⁴	10,28 ⁴
Klasse ZG	10,11	10,38
Klasse ZGP	10,11	10,38
Klasse ZUH	10,23 ³	10,38 ³

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

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

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

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

⁵Siehe Erläuterung 1.

Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	9.475.162
Bankguthaben	2	270.788
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		40.718
Summe Aktiva		9.786.668
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(9.379)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(39.251)
Andere Verbindlichkeiten		(2.627)
Summe Passiva		(51.257)
Nettovermögen insgesamt		9.735.411

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse IU	2.086.832,958
Klasse ZU	53.185,503

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse IU	4,55	3,50	3,65
Klasse ZU	4,55	3,50	3,65

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		9.326.895
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	374.408
Zinsen aus Bankguthaben	2	4.767
Erträge insgesamt		379.175
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(112.602)
Bankspesen		(13)
Sonstige Betriebskosten	5	(31.528)
Aufwendungen insgesamt		(144.143)
Nettoertrag aus Anlagen		235.032
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(336.327)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(240.951)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(39.911)
Realisierter Netto(verlust) aus Steuerrückforderung		745
Realisierter Netto(verlust)		(616.444)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		2.725.170
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Kapitalertragsteuer		(745)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		2.724.425
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		2.343.013
Entwicklung des Fondsvermögens		
Anteilrücknahmen		(1.934.497)
Kapitalbewegungen insgesamt		(1.934.497)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		9.735.411

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	9.735.411	9.326.895	14.607.556

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - STANLIB Global Emerging Markets Property Securities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	6.260.296
Bankguthaben	2	69.372
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		42.840
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		10.108
Sonstige Vermögenswerte	20	62.090
Summe Aktiva		6.444.706
Passiva		
Überziehungskredite		(180.597)
Verbindlichkeiten aus		
Verwaltungsgebühren	5	(6.618)
Andere Verbindlichkeiten		(1.874)
Summe Passiva		(189.089)
Nettovermögen insgesamt		6.255.617

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse IU	512.682,800
-----------	-------------

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse IU	12,20	10,10	9,87

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		3.981.960
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	159.900
Zinsen aus Bankguthaben	2	2.112
Andere Erträge		43.747
Erträge insgesamt		205.759
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(69.570)
Bankspesen		(1.139)
Sonstige Betriebskosten	5	(19.479)
Aufwendungen insgesamt		(90.188)
Nettoertrag aus Anlagen		115.571
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		213.120
Realisierter Netto(verlust) aus		
Devisenterminkontrakten		(101)
Realisierter Netto(verlust) aus		
Devisengeschäften		(4.087)
Realisierter Nettogewinn		208.932
Änderung des nicht realisierten		
Nettogewinns aus Anlagen		556.827
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		556.827
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus		881.330
Geschäftstätigkeit		
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		3.668.858
Anteilrücknahmen		(2.276.531)
Kapitalbewegungen insgesamt		1.392.327
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		6.255.617

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	6.255.617	3.981.960	18.244.936

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	95.885.299
Bankguthaben	2	15.425.183
Termineinlagen	2, 21	107.456.231
Forderungen aus Zeichnungen		1.707.201
Zinsforderungen aus Swapgeschäften	2	280.928
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		77.437
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	163.411
Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften	2, 11	1.255.013
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	2, 10	1.827.904
Sonstige Vermögenswerte		8.850
Summe Aktiva		224.087.457
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.095.935)
Zahlbare Rücknahmen		(9.138)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(45.409)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(173.409)
Andere Verbindlichkeiten		(43.190)
Summe Passiva		(1.367.081)
Nettovermögen insgesamt		222.720.376

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	84.713,910
Klasse AFH	10.740,000
Klasse AGH	4.827.421,608
Klasse AU	685.528,797
Klasse DEH	48.392,185
Klasse DU	117.859,260
Klasse IEH	1.066.944,989
Klasse IGH	79.320,486
Klasse IU	14.897,414
Klasse XGH	4.109.986,176
Klasse ZGH	12.774,242

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEH	16,26 ¹	16,25 ¹	16,30 ¹
Klasse AFH	14,95 ²	15,01 ²	15,11 ²
Klasse AGH	16,89 ³	16,74 ³	16,61 ³
Klasse AU	17,10	16,71	16,48
Klasse DEH	12,79 ¹	12,85 ¹	12,94 ¹
Klasse DU	13,35	13,11	13,00
Klasse IEH	22,96 ¹	22,75 ¹	22,58 ¹
Klasse IGH	23,69 ³	23,37 ³	22,98 ³
Klasse IU	23,97	23,25	22,73
Klasse XGH ⁴	10,23 ³	–	–
Klasse ZGH	16,27 ³	16,00 ³	15,75 ³

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		145.510.117
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	607.670
Zinsen aus Bankguthaben	2	1.199.550
Zinsen aus Swapgeschäften		642.358
Zinsen aus Finanztermingeschäften		6.166
Erträge insgesamt		2.455.744
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(1.983.455)
Performancegebühren	8	(492)
Bankspesen		(30.999)
Dividendenausschüttung Aufwendungen		(550.033)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(436.066)
Sonstige Betriebskosten	5	(524.480)
Aufwendungen insgesamt		(3.525.525)
Netto(verlust) aus Anlagen		(1.069.781)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		8.392.588
Realisierter Netto(verlust) aus Swapgeschäften		(9.511.192)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		21.943.011
Realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften		(4.244.992)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(20.146)
Realisierter Nettogewinn		16.559.269
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		8.525.766
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swapgeschäften		1.898.918
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(2.975.823)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Finanztermingeschäften		1.195.625
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		8.644.486
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		24.133.974
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		116.236.125
Anteilrücknahmen		(63.159.840)
Kapitalbewegungen insgesamt		53.076.285
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		222.720.376

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	222.720.376	145.510.117	169.573.697

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	30.959.435
Bankguthaben	2	4.413.135
Zinsforderungen aus Swapgeschäften	2	699.106
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		7.957
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	2, 10	81.118
Summe Aktiva		36.160.751
Passiva		
Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften		(371.356)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(158.354)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(18.297)
Andere Verbindlichkeiten		(4.254)
Summe Passiva		(552.261)
Nettovermögen insgesamt		35.608.490

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	100,005
Klasse AEH	1.100,002
Klasse DEH	99,995
Klasse IEH	1.616.110,000
Klasse IGH	100,000
Klasse ISH	100,000
Klasse IU	1.538.561,534
Klasse IVH	100,000
Klasse LEH	100,000
Klasse LGH	100,000
Klasse LU	100,000
Klasse ZEH	100,004
Klasse ZFH	44.100,485
Klasse ZU	99,998

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017
Klasse AEC	9,43 ¹	9,59 ¹
Klasse AEH	9,66 ¹	9,82 ¹
Klasse DEH	9,55 ¹	9,77 ¹
Klasse IEH	9,82 ¹	9,89 ¹
Klasse IGH	9,92 ²	9,94 ²
Klasse ISH	10,06 ³	9,98 ³
Klasse IU	10,16	10,01
Klasse IVH	10,22 ⁴	10,05 ⁴
Klasse LEH	10,28 ¹	10,33 ¹
Klasse LGH	10,38 ²	10,35 ²
Klasse LU ⁵	10,06	10,41
Klasse ZEH	9,75 ¹	9,85 ¹
Klasse ZFH	9,71 ⁵	9,84 ⁵
Klasse ZU	10,11	9,99

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁴Die Klasse lautet auf AUD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁵Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

*Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		36.127.762
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	265.468
Zinsen aus Bankguthaben	2	67.863
Zinsen aus Swapgeschäften		62.361
Erträge insgesamt		395.692
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(235.721)
Bankspesen		(4.212)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(362.542)
Sonstige Betriebskosten	5	(55.666)
Sonstige Gebühren	4	(12.831)
Aufwendungen insgesamt		(670.972)
Netto(verlust) aus Anlagen		(275.280)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		20.740
Realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften		1.322.455
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		2.299.803
Realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäfte		(55.762)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		75.119
Realisierter Nettogewinn		3.662.355
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		20.939
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swapgeschäften		(306.984)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(229.972)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Finanztermingeschäfte		3.675
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(512.342)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		2.874.733
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		2.118.527
Anteilrücknahmen		(5.512.532)
Kapitalbewegungen insgesamt		(3.394.005)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		35.608.490

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017
USD	35.608.490	36.127.762

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities*

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.039.466
Bankguthaben	2	2.931
Forderungen aus Zeichnungen		4.029.684
Zinsforderungen aus Swapgeschäften	2	17
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		8.989
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	406
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	2, 10	1.176
Summe Aktiva		5.082.669
Passiva		
Überziehungskredite		(2.934)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.048.096)
Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(19)
Eingegangene Vorauszahlung aus Swapgeschäften	2	(1.194)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften	2, 11	(858)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(110)
Andere Verbindlichkeiten		(373)
Summe Passiva		(1.053.584)
Nettovermögen insgesamt		4.029.085

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	44.559,000
Klasse AFH	189,200
Klasse AUH	200,000
Klasse DE	44.559,000
Klasse IE	44.559,000
Klasse IEP	44.559,000
Klasse IGH	140,800
Klasse IUH	200,000
Klasse JE	44.559,000
Klasse JGH	140,800
Klasse JUH	200,000
Klasse LE	44.559,000
Klasse LEP	44.559,000
Klasse LGH	140,800
Klasse YE	44.559,000
Klasse YGH	140,800
Klasse YUH	200,000
Klasse ZE	44.559,000
Klasse ZFH	189,200
Klasse ZGH	140,800
Klasse ZUH	200,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 28. März 2018 bis 31. März 2018

	Erläuterung	2018 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		–
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	4
Zinsen aus Swapgeschäften		17
Erträge insgesamt		21
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(110)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(19)
Sonstige Betriebskosten	5	(52)
Aufwendungen insgesamt		(181)
Netto(verlust) aus Anlagen		(160)
Realisierter Netto(verlust) aus Swapgeschäften		(1.194)
Realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften		(13)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(646)
Realisierter Netto(verlust)		(1.853)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		745
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swapgeschäften		1.176
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		406
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Finanztermingeschäften		(858)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		1.469
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(544)
Entwicklung des Fondsvermögens		4.029.629
Zeichnungen von Anteilen		4.029.629
Kapitalbewegungen insgesamt		4.029.629
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		4.029.085

GESAMTNETTOINVENTARWERT

31. März 2018
EUR 4.029.085

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities*

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

31. März 2018

Klasse AE [#]	10,00
Klasse AFH [#]	10,00 ¹
Klasse AUH [#]	9,99 ²
Klasse DE [#]	10,00
Klasse IE [#]	10,00
Klasse IEP [#]	10,00
Klasse IGH [#]	10,00 ³
Klasse IUH [#]	9,99 ²
Klasse JE [#]	10,00
Klasse JGH [#]	10,00 ³
Klasse JUH [#]	9,99 ²
Klasse LE [#]	10,00
Klasse LEP [#]	10,00
Klasse LGH [#]	10,00 ³
Klasse YE [#]	10,00
Klasse YGH [#]	10,00 ³
Klasse YUH [#]	9,99 ²
Klasse ZE [#]	10,00
Klasse ZFH [#]	10,00 ¹
Klasse ZGH [#]	10,00 ³
Klasse ZUH [#]	9,99 ²

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

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

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

[#]Siehe Erläuterung 1.

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	10.305.561
Bankguthaben	2	200.872
Termineinlagen	2, 21	400.288
Forderungen aus Zeichnungen		12.403
Zinsforderungen aus Swapgeschäften	2	15.168
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		58.956
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	46.628
Nicht realisierter Nettogewinn aus Finanztermingeschäften	2, 11	17.198
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	2, 10	49.143
Summe Aktiva		11.106.217
Passiva		
Zahlbare Rücknahmen		(45.422)
Zahlbare Rückerstattungen der Vermögensverwaltungsgebühr	2	(4)
Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften		(17.340)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(9.928)
Andere Verbindlichkeiten		(2.448)
Summe Passiva		(75.142)
Nettovermögen insgesamt		11.031.075

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	53.800,046
Klasse AGH	80.814,457
Klasse AU	50.467,361
Klasse DEH	139.901,687
Klasse DU	128.104,511
Klasse IEH	23.957,121
Klasse IU	160.049,849
Klasse ZGH	825,815

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEH	14,69 ¹	14,84 ¹	15,34 ¹
Klasse AGH	15,28 ²	15,31 ²	15,68 ²
Klasse AU	15,55	15,36	15,62
Klasse DEH	11,29 ¹	11,51 ¹	11,99 ¹
Klasse DU	11,92	11,87	12,18
Klasse IEH	20,33 ¹	20,43 ¹	21,07 ¹
Klasse IFH [†]	–	18,43 ³	19,02 ³
Klasse IU	21,59	21,21	21,44
Klasse ZGH	14,43 ²	14,39 ²	14,67 ²

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.²Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.[†]Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		18.591.768
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	668.819
Zinsen aus Bankguthaben	2	12.193
Zinsen aus Swapgeschäften		119.519
Zinsen aus Finanztermingeschäften		1.458
Rückerstattungen der Vermögensverwaltungsgebühr		1.877
Erträge insgesamt		803.866
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(167.623)
Bankspesen		(2.201)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(409.007)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(1.043)
Sonstige Betriebskosten	5	(39.544)
Aufwendungen insgesamt		(619.418)
Nettoertrag aus Anlagen		184.448
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		446.519
Realisierter Netto(verlust) aus Swapgeschäften		(877.210)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		141.086
Realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften		(312.061)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		2.981
Realisierter Netto(verlust)		(598.685)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		666.769
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swapgeschäften		633.633
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(6.441)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Finanztermingeschäften		78.682
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		1.372.643
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		958.406
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		820.886
Anteilrücknahmen		(9.339.985)
Kapitalbewegungen insgesamt		(8.519.099)
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		11.031.075

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	11.031.075	18.591.768	64.319.469

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	28.334.941
Bankguthaben	2	3.628.578
Termineinlagen	2, 21	11.378.484
Forderungen aus Zeichnungen		467.545
Zinsforderungen aus Swapgeschäften	2	1.957.692
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		86.890
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	491.073
Sonstige Vermögenswerte		19.123
Summe Aktiva		46.364.326
Passiva		
Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften		(532.140)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swapgeschäften		(139.607)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swapgeschäften	2, 10	(271.229)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(2.283)
Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	8	(2)
Andere Verbindlichkeiten		(5.453)
Summe Passiva		(950.714)
Nettovermögen insgesamt		45.413.612

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	9.904,625
Klasse AEP	200,000
Klasse AUH	200,000
Klasse DE	200,000
Klasse IE	310.000,000
Klasse IGH	200,000
Klasse LE	93.500,000
Klasse XGH	3.500.231,916
Klasse ZE	344,116
Klasse ZF	100,000
Klasse ZGH	200,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017
Klasse AE	9,94	10,12
Klasse AEP	9,93	10,11
Klasse AUH	10,20 ¹	10,19 ¹
Klasse DE	9,86	10,10
Klasse IE	10,07	10,17
Klasse IGH	10,17 ²	10,20 ²
Klasse LE	10,11	10,18
Klasse XGH	10,33 ²	10,29 ²
Klasse ZE	10,05	10,16
Klasse ZF ³	10,49 ³	–
Klasse ZGH	10,15 ²	10,20 ²

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

*Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		22.794.227
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	388.498
Zinsen aus Swapgeschäften		14.840
Zinsen aus Finanztermingeschäften		106
Erträge insgesamt		403.444
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(45.592)
Performancegebühren	8	(9)
Bankspesen		(73.561)
Dividendenausschüttung Aufwendungen		(459.881)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(174.765)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(6.227)
Sonstige Betriebskosten	5	(59.153)
Sonstige Gebühren	4	(22.619)
Aufwendungen insgesamt		(841.807)
Netto(verlust) aus Anlagen		(438.363)
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(315.502)
Realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften		1.274.870
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(112.766)
Realisierter Netto(verlust) aus Finanztermingeschäften		(397.454)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(2.744)
Realisierter Nettogewinn		446.404
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(258.198)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swapgeschäften		(239.150)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		90.604
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Finanztermingeschäften		651
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(406.093)
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(398.052)
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		28.624.349
Anteilrücknahmen		(5.606.912)
Kapitalbewegungen insgesamt		23.017.437
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		45.413.612

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017
EUR	45.413.612	22.794.227

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	520.470.765
Bankguthaben	2	36.512.988
Forderungen aus Zeichnungen		2.572.830
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		25.524
Summe Aktiva		559.582.107
Passiva		
Zahlbare Rücknahmen		(63.234)
Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(77.776)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(2.586.552)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swapgeschäften	2, 10	(5.174.137)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(249.382)
Andere Verbindlichkeiten		(83.134)
Summe Passiva		(8.234.215)
Nettovermögen insgesamt		551.347.892

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	374.101,581
Klasse AFH	182.642,837
Klasse AGH	59.025,427
Klasse ASH	170.333,274
Klasse AU	1.737.492,910
Klasse DEH	346.164,570
Klasse DU	127.425,592
Klasse IEH	1.115.773,368
Klasse IFH	25.000,000
Klasse IGH	5.032.144,575
Klasse IKH	9.320.768,134
Klasse IU	4.764.781,778
Klasse XU	12.750.655,366
Klasse ZEH	886.699,195
Klasse ZFH	53.676,000
Klasse ZGH	403.106,956
Klasse ZU	564.761,007

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
Klasse AEH	9,62 ¹	9,67 ¹	9,12 ¹
Klasse AFH	7,17 ²	7,24 ²	6,86 ²
Klasse AGH	10,07 ³	10,05 ³	9,43 ³
Klasse ASH	5,15 ⁴	5,09 ⁴	4,73 ⁴
Klasse AU	10,54	10,34	9,58
Klasse DEH	7,42 ¹	7,49 ¹	7,10 ¹
Klasse DU	8,13	8,01	7,46
Klasse IEH	13,72 ¹	13,66 ¹	12,79 ¹
Klasse IFH	10,21 ²	10,21 ²	9,60 ²
Klasse IGH	14,32 ³	14,16 ³	13,18 ³
Klasse IKH	105,98 ⁵	105,73 ⁵	99,34 ⁵
Klasse IU	15,01	14,59	13,41
Klasse XGH ⁶	–	13,54 ³	12,46 ³
Klasse XU	15,46	14,87	13,51
Klasse ZEH	5,81 ¹	5,78 ¹	5,40 ¹
Klasse ZFH	5,66 ²	5,66 ²	5,31 ²
Klasse ZGH	8,22 ³	8,12 ³	7,54 ³
Klasse ZU	6,20	6,02	5,52

¹Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD²Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.³Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁴Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁵Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.⁶Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das am 31. März 2018 endende Geschäftsjahr

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Jahres		420.179.793
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	4.377.879
Zinsen aus Bankguthaben	2	272.646
Andere Erträge		336
Erträge insgesamt		4.650.861
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(3.365.612)
Bankspesen		(21.883)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(877.272)
Sonstige Betriebskosten	5	(1.068.401)
Sonstige Gebühren	4	(10.564)
Aufwendungen insgesamt		(5.343.732)
Netto(verlust) aus Anlagen		(692.871)
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(161.048)
Realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften		12.641.887
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		20.429.031
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(38.634)
Realisierter Nettogewinn		32.871.236
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		383.369
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swapgeschäften		4.492.523
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(5.718.875)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(842.983)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		31.335.382
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		187.454.279
Anteilrücknahmen		(87.621.562)
Kapitalbewegungen insgesamt		99.832.717
Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		551.347.892

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018	31. März 2017	31. März 2016
USD	551.347.892	420.179.793	301.823.229

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity*

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	11.381.802
Bankguthaben	2	121.924
Forderungen aus Dividenden, netto		26.995
Sonstige Vermögenswerte		1.531
Summe Aktiva		11.532.252
Passiva		
Verbindlichkeiten aus		
Verwaltungsgebühren	5	(6.964)
Andere Verbindlichkeiten		(3.006)
Summe Passiva		(9.970)
Nettovermögen insgesamt		11.522.282

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AU	500.029,037
Klasse XU	500.000,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2018
Klasse AU [#]	11,53
Klasse XU [#]	11,52

*Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 26. April 2017 bis 31. März 2018

	Erläuterung	2018 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		–
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	153.654
Erträge insgesamt		153.654
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(76.620)
Sonstige Betriebskosten	5	(30.562)
Sonstige Gebühren	4	(220)
Aufwendungen insgesamt		(107.402)
Nettoertrag aus Anlagen		46.252
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		1.032.121
Realisierter Netto(verlust) aus		
Devisengeschäften		(5.042)
Realisierter Nettogewinn		1.027.079
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns		
aus Anlagen		435.926
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		435.926
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus		
Geschäftstätigkeit		1.509.257
Entwicklung des Fondsvermögens		
Zeichnungen von Anteilen		15.794.842
Anteilrücknahmen		(5.781.817)
Kapitalbewegungen insgesamt		10.013.025
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		11.522.282

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2018
USD	11.522.282

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterung sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens				
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)							
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)							
AUSTRALIEN				SCHWEIZ							
USD	200.000	SGSP Australia Assets Pty Limited 3.30% 09/04/2023	197.917	1,11	USD	200.000	UBS Group AG FRN Perp.	215.454	1,21		
Summe Australien				197.917	1,11	Summe Schweiz		215.454	1,21		
KANADA				VEREINIGTES KÖNIGREICH							
USD	77.000	Glencore Finance (Canada) Limited 4.95% 15/11/2021	80.362	0,45	USD	272.000	Barclays plc 4.38% 11/09/2024	266.638	1,49		
Summe Kanada				80.362	0,45	GBP	100.000	Bupa Finance plc 5.00% 25/04/2023	154.214	0,86	
KAIMANINSELN				VEREINIGTE STAATEN							
USD	35.000	Noble Holding International Limited 8.70% 01/04/2045	29.351	0,16	GBP	50.000	Legal & General Group plc FRN 23/07/2041	86.877	0,48		
Summe Kaimaninseln				29.351	0,16	GBP	170.000	National Westminster Bank 6.50% 07/09/2021	271.360	1,53	
DÄNEMARK				VEREINIGTE STAATEN							
GBP	25.000	Danske Bank FRN 29/09/2021	35.678	0,20	USD	180.000	AT&T Inc. 4.13% 17/02/2026	181.083	1,02		
Summe Dänemark				35.678	0,20	USD	77.000	AT&T Inc. 4.90% 14/08/2037	77.703	0,44	
GUERNSEY - KANALINSELN				VEREINIGTE STAATEN							
GBP	165.000	Credit Suisse Group Funding Guernsey Limited 2.75% 08/08/2025	234.127	1,31	USD	68.000	Becton Dickinson and Company 3.70% 06/06/2027	65.735	0,37		
Summe Guernsey - Kanalinseln				234.127	1,31	USD	105.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	101.581	0,57	
IRLAND				VEREINIGTE STAATEN							
EUR	200.000	Bank of Ireland FRN Perp.	273.641	1,54	USD	54.000	Loews Corp. 3.75% 01/04/2026	54.580	0,31		
Summe Irland				273.641	1,54	USD	60.000	Molson Coors Brewing Company 5.00% 01/05/2042	63.717	0,36	
MEXIKO				VEREINIGTE STAATEN							
USD	200.000	Cemex SAB De CV 7.75% 16/04/2026	220.835	1,24	USD	125.000	Nisource Finance Corp. 4.80% 15/02/2044	131.862	0,74		
USD	81.000	Petroleos Mexicanos 6.50% 13/03/2027	86.630	0,49	USD	60.000	Northrop Grumman Corp. 4.03% 15/10/2047	57.907	0,32		
Summe Mexiko				307.465	1,73	USD	70.000	PPL Capital Funding Inc. 3.95% 15/03/2024	71.320	0,40	
NIEDERLANDE				VEREINIGTE STAATEN							
USD	75.000	LYB International Finance BV 4.88% 15/03/2044	78.631	0,44	USD	184.000	Sempra Energy 3.55% 15/06/2024	183.208	1,03		
USD	81.000	Petrobras Global Finance BV 7.38% 17/01/2027	87.813	0,49	USD	215.000	Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	213.006	1,18		
Summe Niederlande				166.444	0,93	USD	100.000	Welltower Inc. 4.25% 01/04/2026	101.512	0,57	
				Summe Vereinigte Staaten				1.303.214	7,31		
				BRITISCHE JUNGFERNINSELN							
				USD				200.000	Hongkong Electric Finance Limited 2.88% 03/05/2026	187.332	1,05
				Summe Britische Jungferninseln				187.332	1,05		
				Summe Anleihen				3.951.001	22,15		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					
ARGENTINIEN				ITALIEN					
USD	180.000	Argentina (Govt of) 7.50% 22/04/2026	192.720	1,08	EUR	225.000	Italy (Govt of) BPT 1.35% 15/04/2022	287.229	1,61
		Summe Argentinien	192.720	1,08	EUR	65.000	Italy (Govt of) BPT 2.50% 01/12/2024	86.814	0,49
					EUR	133.000	Italy (Govt of) BPT 2.70% 01/03/2047	161.900	0,91
						Summe Italien	535.943	3,01	
					ELFENBEINKÜSTE				
					USD	250.000	Ivory Coast (Govt of) 5.38% 23/07/2024	245.080	1,37
						Summe Elfenbeinküste	245.080	1,37	
					JAPAN				
					JPY	21.800.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 1.40% 20/12/2045	241.089	1,35
					JPY	43.000.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 1.60% 20/06/2045	495.440	2,78
						Summe Japan	736.529	4,13	
					NIEDERLANDE				
					EUR	368.000	Netherlands (Govt of) 0.50% 15/07/2026	456.381	2,56
						Summe Niederlande	456.381	2,56	
					SENEGAL				
					USD	200.000	Senegal (Govt of) 6.25% 30/07/2024	208.660	1,17
						Summe Senegal	208.660	1,17	
					SÜDAFRIKA				
					ZAR	13.123.891	South Africa (Govt of) 8.50% 31/01/2037	1.077.091	6,04
						Summe Südafrika	1.077.091	6,04	
					SPANIEN				
					EUR	70.000	Spain (Govt of) 1.95% 30/04/2026	93.388	0,52
					EUR	36.000	Spain (Govt of) 2.15% 31/10/2025	48.827	0,27
					EUR	30.000	Spain (Govt of) 5.15% 31/10/2044	59.770	0,34
						Summe Spanien	201.985	1,13	
					HONDURAS				
					USD	200.000	Honduras (Govt of) 7.50% 15/03/2024	221.858	1,24
						Summe Honduras	221.858	1,24	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt (Fortsetzung)					
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen					
SUPRANATIONAL				VEREINIGTE STAATEN					
EUR	187.000	European Union 0.63% 04/11/2023	235.511	1,32	USD	100.229	Fannie Mae Pool 3.50% 01/04/2026	102.488	0,57
Summe Supranational			235.511	1,32	USD	147.872	Fannie Mae Pool 3.50% 01/12/2041	149.499	0,85
VEREINIGTES KÖNIGREICH				VEREINIGTE STAATEN					
GBP	150.000	United Kingdom Gilt 3.25% 22/01/2044	276.686	1,55	USD	21.064	Fannie Mae Pool 4.50% 01/11/2035	22.224	0,12
GBP	55.000	United Kingdom Gilt 3.50% 22/07/2068	131.448	0,74	USD	59.474	Fannie Mae Pool 4.50% 01/06/2038	62.786	0,35
Summe Vereinigtes Königreich			408.134	2,29	USD	6.435	Fannie Mae Pool 6.00% 01/11/2036	7.276	0,04
VEREINIGTE STAATEN				VEREINIGTE STAATEN					
USD	1.719.000	United States Treasury N/B 0.63% 30/06/2018	1.714.299	9,61	USD	75.381	Freddie Mac Gold Pool 3.50% 01/04/2042	75.997	0,43
Summe Vereinigte Staaten			1.714.299	9,61	USD	56.939	Freddie Mac Gold Pool 4.00% 01/06/2031	59.256	0,33
Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				Summe Vereinigte Staaten					
			7.655.372	42,93	USD	67.164	Freddie Mac Gold Pool 4.00% 01/04/2041	69.654	0,39
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Summe Forderungs- und hypothekenbesicherte Wertpapiere					
			11.606.373	65,08	USD	100.750	Freddie Mac Gold Pool 4.00% 01/08/2041	101.422	0,57
				Summe Vereinigte Staaten					
				650.602					
				3,65					
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente					
				KANADA					
				CAD 880.000 Canada Housing Trust No 1 2.00% 15/12/2019				685.436	3,84
				Summe Kanada				685.436	3,84
Anleihen				RUSSISCHE FÖDERATION					
PORTUGAL				RUSSISCHE FÖDERATION					
EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2019	36.896	0,21	RUB	144.357.000	Russia (Govt of) 7.50% 18/08/2021	2.594.195	14,53
Summe Portugal			36.896	0,21	Summe Russische Föderation			2.594.195	14,53
VEREINIGTE STAATEN				VEREINIGTE STAATEN					
USD	105.000	Peachtree Fund Trust 3.98% 15/02/2025	105.237	0,59	USD	175.000	Port Authority of New York & New Jersey 4.46% 01/10/2062	191.821	1,08
USD	65.000	Teachers Insurance & Annuity Association America 4.90% 15/09/2044	71.410	0,40	Summe Vereinigte Staaten			191.821	1,08
Summe Vereinigte Staaten			176.647	0,99	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
Summe Anleihen			213.543	1,20				3.471.452	19,45

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt (Fortsetzung)			
Aktien			
VEREINIGTE STAATEN			
155.000	Five Corners Funding P.P. 144A 15/11/2023	162.159	0,91
119.526	Freddie Mac Gold Pool 01/02/2041	120.345	0,67
	Summe Vereinigte Staaten	282.504	1,58
	Summe Aktien	282.504	1,58
	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt	4.618.101	25,88
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Fonds			
LUXEMBURG			
111	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond Portfolio - AU	3.611	0,02
	Summe Luxemburg	3.611	0,02
	Summe Fonds	3.611	0,02
	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	3.611	0,02
	Wert der Anlagen, insgesamt	16.228.085	90,98
(Gesamtkosten: USD 15.292.051)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
AUSTRALIEN				FRANKREICH					
USD	845.000	Asciano Finance 4.75% 22/03/2028	839.048	0,59	EUR	200.000	Elis SA 1.88% 15/02/2023	245.332	0,17
GBP	400.000	Asciano Finance Limited 5.00% 19/09/2023	625.830	0,44	EUR	200.000	SFR Group SA 5.38% 15/05/2022	251.180	0,18
AUD	150.000	Aurizon Network Pty Limited 4.00% 21/06/2024	115.997	0,08	Summe Frankreich				
EUR	385.000	Ausnet Services Holdings Pty Limited 3.00% 13/02/2024	535.790	0,37	496.512 0,35				
EUR	308.000	BHP Billiton Finance Limited FRN 22/10/2079	458.252	0,32	DEUTSCHLAND				
AUD	350.000	Holcim Finance Australia PTY Limited 3.50% 16/06/2022	272.410	0,19	EUR	190.000	Adler Real Estate AG 1.50% 06/12/2021	233.942	0,16
USD	1.215.000	SGSP Australia Assets Pty 3.50% 07/07/2027	1.176.729	0,82	EUR	800.000	Eurogrid GmbH 1.63% 03/11/2023	1.034.199	0,72
EUR	500.000	Sydney Airport Finance Company Pty Limited 2.75% 23/04/2024	676.106	0,47	EUR	100.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.25% 15/09/2023	126.751	0,09
Summe Australien			4.700.162	3,28	EUR	308.000	Unitymedia Hessen GmbH & Company 4.00% 15/01/2025	399.987	0,28
				Summe Deutschland					
				1.794.879 1,25					
				GUERNSEY - KANALINSELN					
				USD 1.098.000 Credit Suisse Group Funding Guernsey Limited 4.55% 17/04/2026				1.125.797	0,78
				Summe Guernsey - Kanalinseln					
				1.125.797 0,78					
ÖSTERREICH				HONGKONG					
EUR	500.000	Bawag PSK 8.13% 30/10/2023	828.652	0,58	USD	1.028.000	China National Chemical Corporation 4.63% 14/03/2023	1.034.795	0,72
Summe Österreich			828.652	0,58	Summe Hongkong				
				1.034.795 0,72					
KANADA				ISLAND					
USD	150.000	Canadian Natural Resources Limited 3.80% 15/04/2024	149.965	0,10	EUR	453.000	Arion Banki Hf 1.63% 01/12/2021	578.130	0,40
USD	218.000	Canadian Natural Resources Limited 6.25% 15/03/2038	263.455	0,18	Summe Island				
Summe Kanada			413.420	0,28	578.130 0,40				
KAIMANINSELN				INDIEN					
USD	532.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	505.762	0,35	USD	630.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	577.239	0,40
USD	260.000	HPHT Finance 2.75% 11/09/2022	249.361	0,17	Summe Indien				
USD	152.000	Noble Holding International Limited 8.70% 01/04/2045	127.466	0,09	577.239 0,40				
USD	400.000	Sunny Optical Technology Group Company Limited 3.75% 23/01/2023	396.012	0,28	IRLAND				
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 3.93% 19/01/2038	190.453	0,13	GBP	150.000	FCA Bank SpA 1.63% 29/09/2021	208.220	0,15
GBP	434.000	Thames Water Utilities Cayman Finance Limited 2.38% 03/05/2023	595.224	0,42	USD	700.000	GE Capital International Funding Company 4.42% 15/11/2035	683.056	0,48
Summe Kaimaninseln			2.064.278	1,44	Summe Irland				
				891.276 0,63					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
ITALIEN				NIEDERLANDE (Fortsetzung)					
EUR	160.000	FCA Bank SpA FRN 17/06/2021	196.411	0,14	EUR	400.000	Telefonica Europe BV 3.00% Perp.	487.047	0,34
		Summe Italien	196.411	0,14	EUR	463.000	TenneT Holding BV FRN Perp.	582.289	0,41
					EUR	300.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 0.38% 25/07/2020	359.324	0,25
JERSEY - KANALINSELN					EUR	600.000	Vonovia Finance BV 2.75% 22/03/2038	747.791	0,52
GBP	350.000	Cpuk Finance Limited 2.67% 28/02/2020	499.243	0,35			Summe Niederlande	3.940.126	2,74
GBP	318.000	Heathrow Funding Limited 5.23% 15/02/2023	514.465	0,36					
		Summe Jersey - Kanalinseln	1.013.708	0,71					
LUXEMBURG				SPANIEN					
EUR	400.000	Ado Properties SA 1.50% 26/07/2024	490.157	0,34	EUR	510.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	632.044	0,44
USD	680.000	Allergan Funding SCS 3.80% 15/03/2025	668.957	0,47			Summe Spanien	632.044	0,44
EUR	835.000	Bevco Lux Sarl 1.75% 09/02/2023	1.026.388	0,72	SCHWEDEN				
EUR	500.000	Gazprom OAO via Gaz Capital 2.50% 21/03/2026	607.583	0,42	EUR	585.000	Akelius Residential AB 3.88% 05/10/2078	719.962	0,50
GBP	365.000	Glencore Finance Europe SA 6.00% 03/04/2022	584.967	0,41	EUR	616.000	Akelius Residential Property AB 1.75% 07/02/2025	756.142	0,53
EUR	400.000	Grand City Properties SA 1.38% 03/08/2026	480.459	0,34	GBP	640.000	Akelius Residential Property AB 2.38% 15/08/2025	867.006	0,60
EUR	800.000	Grand City Properties SA 1.50% 17/04/2025	987.274	0,69			Summe Schweden	2.343.110	1,63
EUR	460.000	Richemont International Holding SA 1.00% 26/03/2026	563.737	0,39	SCHWEIZ				
EUR	1.330.000	Selp Finance Sarl 1.25% 25/10/2023	1.637.173	1,13	USD	250.000	Credit Suisse Group FRN 12/01/2029	242.383	0,17
		Summe Luxemburg	7.046.695	4,91	USD	330.000	Credit Suisse Group AG FRN Perp.	357.983	0,25
MEXIKO					EUR	400.000	UBS Group AG FRN Perp.	549.578	0,38
USD	250.000	Grupo Bimbo SAB de CV 3.88% 27/06/2024	251.962	0,18	USD	550.000	UBS Group Funding FRN Perp.	515.403	0,36
EUR	505.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 16/04/2026	639.676	0,45			Summe Schweiz	1.665.347	1,16
		Summe Mexiko	891.638	0,63	VEREINIGTES KÖNIGREICH				
NIEDERLANDE				EUR	185.000	Annington Funding plc 1.65% 12/07/2024	228.516	0,16	
EUR	210.000	Alliander NV FRN Perp.	256.809	0,18	GBP	270.000	Annington Funding plc 3.94% 12/07/2047	400.043	0,28
EUR	238.000	Enexis Holding NV 1.50% 20/10/2023	306.628	0,21	GBP	200.000	Aviva plc FRN 04/06/2050	298.832	0,21
GBP	450.000	Innogy Finance BV 6.25% 03/06/2030	838.444	0,58	GBP	470.000	Barclays plc 3.25% 17/01/2033	639.615	0,45
USD	278.000	LYB International Finance BV 4.88% 15/03/2044	291.460	0,20	GBP	480.000	Barclays plc FRN Perp.	671.159	0,47
GBP	49.000	PostNL NV 7.50% 14/08/2018	70.334	0,05	USD	835.000	BP Capital Markets 3.28% 19/09/2027	812.443	0,57
					EUR	530.000	British Telecommunication 1.00% 21/11/2024	642.125	0,45

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					
GBP	785.000	Bunzl Finance plc 2.25% 11/06/2025	1.083.308	0,76	USD	335.000	Reckitt Benckiser Treasury 2.75% 26/06/2024	319.285	0,23
GBP	663.000	BUPA Finance plc 2.00% 05/04/2024	920.714	0,64	USD	1.012.000	Royal Bank of Scotland Group plc 4.80% 05/04/2026	1.045.606	0,73
GBP	508.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	795.799	0,55	GBP	500.000	Severn Trent Water 3.63% 16/01/2026	758.352	0,52
EUR	956.000	Cadent Finance plc 0.63% 22/09/2024	1.151.708	0,81	GBP	200.000	Standard Chartered plc 4.38% 18/01/2038	311.068	0,22
GBP	908.000	Cadent Finance plc 2.13% 22/09/2028	1.206.876	0,84	GBP	375.000	Telereal FRN 10/12/2033	551.687	0,38
GBP	276.000	Cybg plc FRN 09/02/2026	402.281	0,28	GBP	145.373	Telereal 4.97% 10/09/2027	231.733	0,16
EUR	750.000	DS Smith plc 1.38% 26/07/2024	923.026	0,64	GBP	323.188	Tesco Property Finance 7.62% 13/07/2039	608.495	0,42
GBP	285.000	Eversholt Funding plc 3.53% 07/08/2042	400.682	0,28	GBP	151.993	Tesco Property Finance 4 plc 5.80% 13/10/2040	248.159	0,17
EUR	200.000	Experian Finance plc 1.38% 25/06/2026	244.784	0,17	GBP	413.915	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	669.416	0,47
GBP	840.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	1.444.745	1,00	GBP	481.000	Western Power Distribution 3.63% 06/11/2023	714.055	0,50
EUR	540.000	G4S International Finance plc 1.50% 09/01/2023	682.473	0,47	Summe Vereinigtes Königreich		28.298.030	19,73	
EUR	110.000	G4S International Finance plc 1.50% 02/06/2024	136.596	0,10	VEREINIGTE STAATEN				
GBP	608.000	GKN Holdings plc 3.38% 12/05/2032	860.893	0,60	USD	100.000	21st Century Fox America Inc. 4.75% 15/11/2046	108.842	0,08
GBP	595.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	922.067	0,64	USD	540.000	American International Group Inc. 3.90% 01/04/2026	535.672	0,37
GBP	92.517	Greene King Finance 4.06% 15/03/2035	139.874	0,10	USD	75.000	Anadarko Petroleum Corp. 3.45% 15/07/2024	72.857	0,05
GBP	1.270.000	HSBC Holdings plc FRN 13/11/2026	1.739.683	1,20	USD	1.160.000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc. 4.70% 01/02/2036	1.228.250	0,86
USD	200.000	HSBC Holdings plc FRN Perp.	198.343	0,14	USD	700.000	Anheuser-Busch Inbev SA 4.00% 13/04/2028	707.571	0,49
EUR	1.033.000	Imperial Brands Finance plc 0.50% 27/07/2021	1.277.807	0,89	USD	475.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 3.75% 15/01/2022	484.763	0,33
GBP	670.000	Land Securities 2.38% 29/03/2027	943.077	0,66	USD	108.000	Appalachian Power Company 4.40% 15/05/2044	112.773	0,08
GBP	200.000	Legal & General Group FRN 27/06/2064	309.789	0,22	USD	728.000	Apple Inc. 2.85% 11/05/2024	710.604	0,50
GBP	440.000	Lloyds Banking Group plc 2.25% 16/10/2024	605.462	0,42	EUR	600.000	AT&T Inc. 1.80% 05/09/2026	751.377	0,52
GBP	200.000	Lloyds Banking Group plc FRN Perp.	339.008	0,24	CAD	400.000	AT&T Inc. 3.83% 25/11/2020	319.791	0,22
GBP	350.000	Marks & Spencer plc 6.13% 02/12/2019	527.036	0,36	USD	1.354.000	AT&T Inc. 4.90% 14/08/2037	1.366.355	0,96
GBP	140.000	National Westminster Bank 6.50% 07/09/2021	223.473	0,16	USD	1.580.000	Bank of America Corp. 3.71% 24/04/2028	1.556.482	1,08
EUR	509.000	NGG Finance plc FRN 18/06/2076	674.402	0,47	USD	1.590.000	BAT Capital Corp. 3.22% 15/08/2024	1.533.856	1,07
GBP	705.000	Pennon Group plc FRN Perp.	993.535	0,70	USD	420.000	Becton Dickinson and Company 3.70% 06/06/2027	406.010	0,29
					USD	450.000	Celgene Corp. 4.55% 20/02/2048	442.636	0,31
					USD	355.000	CMS Energy Corp. 3.60% 15/11/2025	351.333	0,24
					USD	476.000	Comcast Corp. 3.00% 01/02/2024	464.025	0,32

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					
USD	664.000	Comcast Corp. 3.90% 01/03/2038	645.960	0,45	USD	1.128.000	Nisource Finance Corp. 4.80% 15/02/2044	1.189.918	0,83
USD	100.000	Consumers Energy Company 3.95% 15/07/2047	101.688	0,07	USD	750.000	Northrop Grumman Corp. 4.03% 15/10/2047	723.833	0,51
USD	150.000	CSX Corp. 3.80% 01/11/2046	138.675	0,10	USD	1.000.000	Oracle Corp. 2.95% 15/11/2024	973.624	0,69
USD	530.000	CVS Health Corp. 3.88% 20/07/2025	526.408	0,37	USD	720.000	Oracle Corp. 3.80% 15/11/2037	709.823	0,49
USD	300.000	CVS Health Corp. 5.05% 25/03/2048	315.639	0,22	USD	377.000	Pacific Gas & Electric Company 4.75% 15/02/2044	392.125	0,27
GBP	810.000	Digital Stout Holding LLC 3.30% 19/07/2029	1.146.824	0,80	USD	866.000	Plains All American Pipeline LP 4.65% 15/10/2025	873.003	0,60
GBP	620.000	Discovery Communications LLC 2.50% 20/09/2024	856.016	0,60	USD	183.000	Plains All American Pipeline LP 4.65% 15/10/2025	184.480	0,13
USD	948.000	Dte Energy Company 2.85% 01/10/2026	874.231	0,61	USD	278.000	Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	248.487	0,17
USD	996.000	Dte Energy Company 3.85% 01/12/2023	1.010.225	0,70	EUR	260.000	Quintiles IMS Inc. 3.25% 15/03/2025	321.163	0,22
USD	123.000	Duke Energy Corp. 3.75% 01/09/2046	111.933	0,08	USD	435.000	Relx Capital Inc. 3.50% 16/03/2023	435.620	0,30
USD	779.000	Duke Energy Progress Inc. 4.20% 15/08/2045	809.886	0,56	USD	188.000	Sempra Energy 3.55% 15/06/2024	187.191	0,13
EUR	335.000	Equinix Inc. 2.88% 01/10/2025	397.321	0,28	USD	756.000	Southern Company 4.40% 01/07/2046	757.794	0,53
EUR	165.000	Equinix Inc. 2.88% 01/02/2026	193.929	0,14	USD	332.000	UnitedHealth Group Inc. 3.45% 15/01/2027	329.165	0,23
USD	586.000	Firstenergy Corp. 3.90% 15/07/2027	576.128	0,40	USD	347.000	Verizon Communications Inc. 4.13% 16/03/2027	351.806	0,25
USD	385.000	Florida Power & Light Company 4.05% 01/10/2044	399.047	0,28	USD	347.000	Verizon Communications Inc. 4.13% 16/03/2027	351.806	0,25
USD	500.000	Indiana Michigan Power Company 3.75% 01/07/2047	475.015	0,33	USD	1.016.000	Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	1.006.579	0,70
USD	81.000	Indiana Michigan Power Company 6.05% 15/03/2037	100.631	0,07	USD	440.000	Voya Financial Inc. 3.13% 15/07/2024	423.951	0,30
USD	897.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	867.795	0,61	USD	1.200.000	Wells Fargo & Company FRN 22/05/2028	1.170.990	0,82
USD	350.000	Kroger Company 4.65% 15/01/2048	340.395	0,24	GBP	550.000	Welltower Inc. 4.80% 20/11/2028	888.560	0,62
EUR	304.000	Liberty Mutual Group 2.75% 04/05/2026	401.700	0,28			Summe Vereinigte Staaten	35.296.469	24,62
USD	506.000	Lockheed Martin Corp. 4.50% 15/05/2036	537.248	0,37			BRITISCHE JUNGFERNINSELN		
USD	225.000	Medtronic Inc. 4.63% 15/03/2045	246.784	0,17	EUR	595.000	Cheung Kong Infrastructure Holdings 1.00% 12/12/2024	725.061	0,51
USD	509.000	Microsoft Corp. 2.88% 06/02/2024	500.561	0,35	GBP	573.000	Global Switch Holdings Limited 4.38% 13/12/2022	888.896	0,62
USD	362.000	Microsoft Corp. 4.10% 06/02/2037	383.375	0,27	USD	1.050.000	Hongkong Electric Finance Limited 2.88% 03/05/2026	983.494	0,69
EUR	200.000	Molson Coors Brewing Company 1.25% 15/07/2024	246.633	0,17	USD	490.000	State Grid Overseas Investment Limited 3.50% 04/05/2027	473.732	0,33
USD	285.000	Molson Coors Brewing Company 5.00% 01/05/2042	302.655	0,21			Summe Britische Jungfernseln	3.071.183	2,15
USD	350.000	Nevada Power Company 6.65% 01/04/2036	468.458	0,33			Summe Anleihen	98.899.901	68,97

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt (Fortsetzung)						
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				Anleihen (Fortsetzung)						
DEUTSCHLAND				NIEDERLANDE						
EUR	280.000	Germany (Govt of) 2.50% 15/08/2046	460.377	0,32	USD	220.000	E.ON International Finance BV 6.65% 30/04/2038	281.406	0,20	
		Summe Deutschland	460.377	0,32	USD	359.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	371.668	0,26	
VEREINIGTE STAATEN				Summe Niederlande						
USD	9.055.000	United States Treasury N/B 1.75% 30/06/2022	8.779.104	6,13				653.074	0,46	
USD	7.650.000	United States Treasury N/B 1.88% 31/12/2019	7.602.188	5,30	PORTUGAL					
USD	310.000	United States Treasury N/B 2.13% 30/11/2023	301.984	0,21	EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2019	36.896	0,03	
USD	194.000	United States Treasury N/B 2.25% 15/08/2027	186.088	0,13			Summe Portugal	36.896	0,03	
USD	6.779.000	United States Treasury N/B 2.75% 15/08/2047	6.475.004	4,51	VEREINIGTE STAATEN					
USD	73.000	United States Treasury N/B 3.00% 15/05/2047	73.314	0,05	USD	385.000	Amgen Inc. 2.65% 11/05/2022	375.778	0,26	
		Summe Vereinigte Staaten	23.417.682	16,33	USD	500.000	Apple Inc. 2.90% 12/09/2027	476.412	0,33	
Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				23.878.059	16,65	USD	439.000	Broadcom Cayman Finance 3.00% 15/01/2022	431.063	0,30
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				122.777.960	85,62	USD	800.000	Broadcom Cayman Finance 3.63% 15/01/2024	787.734	0,55
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt						USD	100.000	Erac USA Finance LLC 3.30% 01/12/2026	96.277	0,07
Anleihen						USD	152.000	Erac USA Finance LLC P.P. 144A 4.50% 15/02/2045	150.552	0,10
AUSTRALIEN						USD	875.000	Goodman US Finance 3.70% 15/03/2028	841.743	0,59
USD	585.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	585.329	0,41	USD	100.000	Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	102.933	0,07	
USD	60.000	Asciano Finance Limited 5.00% 07/04/2018	60.010	0,04	USD	1.000.000	Johnson & Johnson 3.40% 15/01/2038	968.866	0,67	
		Summe Australien	645.339	0,45	USD	1.320.000	JPMorgan Chase & Company FRN 24/07/2038	1.284.152	0,90	
KANADA						USD	971.000	Mass Mutual Global Funding II 2.75% 22/06/2024	938.877	0,65
CAD	200.000	Canadian Natural Resources Limited 4.85% 30/05/2047	159.244	0,11	USD	85.000	Massachusetts Mutual Life Insurance Company P.P. 144A 4.50% 15/04/2065	82.364	0,06	
USD	499.000	Cenovus Energy Inc. 4.25% 15/04/2027	487.118	0,34	USD	400.000	Metropolitan Life Global Funding 3.45% 18/12/2026	393.597	0,27	
USD	432.000	Cenovus Energy Inc. 5.40% 15/06/2047	435.733	0,30	USD	358.000	Midamerican Energy Company 3.65% 01/08/2048	345.051	0,24	
CAD	430.000	Rogers Communications Inc. 4.00% 13/03/2024	350.506	0,24	CAD	400.000	Molson Coors International LP 2.75% 18/09/2020	310.181	0,22	
		Summe Kanada	1.432.601	0,99	USD	192.000	Mplx LP 4.90% 15/04/2058	184.416	0,13	
					USD	800.000	Northwestern Mutual 3.85% 30/09/2047	758.868	0,53	
					USD	390.000	Peachtree Fund Trust 3.98% 15/02/2025	390.880	0,27	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
USD 501.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	502.404	0,35
	Summe Vereinigte Staaten	9.422.148	6,56
Summe Anleihen		12.190.058	8,49
Aktien			
VEREINIGTE STAATEN			
817.000	Five Corners Funding P.P. 144A 15/11/2023	854.733	0,60
	Summe Vereinigte Staaten	854.733	0,60
Summe Aktien		854.733	0,60
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt			
		13.044.791	9,09
Wert der Anlagen, insgesamt		135.822.751	94,71
(Gesamtkosten: USD 134.453.462)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond*

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
ÖSTERREICH				DEUTSCHLAND (Fortsetzung)					
EUR	200.000	Bawag PSK 8.13% 30/10/2023	269.513	1,75	EUR	300.000	Eurogrid GmbH 1.63% 03/11/2023	315.344	2,04
Summe Österreich			269.513	1,75	Summe Deutschland			840.226	5,44
DÄNEMARK				IRLAND					
EUR	110.000	ISS Global A/S 2.13% 02/12/2024	117.496	0,76	EUR	200.000	Gas Networks Ireland 1.38% 05/12/2026	204.741	1,33
EUR	100.000	Orsted A/S 1.50% 26/11/2029	99.747	0,65	EUR	200.000	Swisscom AG via Lunar Funding 1.75% 15/09/2025	212.124	1,37
EUR	200.000	Orsted AS FRN 24/11/3017	198.552	1,29	EUR	100.000	Transmission Finance 1.50% 24/05/2023	104.033	0,67
Summe Dänemark			415.795	2,70	Summe Irland			520.898	3,37
FRANKREICH				ITALIEN					
EUR	100.000	Aeroports de Paris 1.00% 13/12/2027	98.527	0,64	EUR	100.000	Aeroporti di Roma SpA 1.63% 08/06/2027	101.570	0,66
EUR	100.000	AXA SA FRN Perp.	107.376	0,70	EUR	200.000	Hera SpA 5.20% 29/01/2028	263.260	1,71
EUR	200.000	Banque Federative du Credit Mutuel 1.25% 26/05/2027	199.933	1,29	EUR	200.000	Intesa Sanpaolo SpA 0.88% 27/06/2022	201.550	1,31
EUR	300.000	BNP Paribas 0.50% 01/06/2022	301.375	1,95	Summe Italien			566.380	3,68
EUR	300.000	BPCE SA 1.13% 14/12/2022	309.406	2,00	NIEDERLANDE				
EUR	200.000	BPCE SA 2.88% 22/04/2026	215.478	1,40	EUR	75.000	ABN Amro Bank NV 0.63% 31/05/2022	75.905	0,49
EUR	300.000	CNP Assurances 1.88% 20/10/2022	312.254	2,02	GBP	100.000	Deutsche Bahn Finance BV 1.38% 07/07/2025	111.421	0,72
EUR	300.000	Credit Agricole Assurances SA FRN Perp.	325.671	2,11	EUR	100.000	Enexis Holding NV 0.88% 28/04/2026	99.114	0,64
EUR	200.000	Credit Agricole SA 3.90% 19/04/2021	221.814	1,44	EUR	200.000	Iberdrola International BV FRN Perp.	196.758	1,27
EUR	300.000	Danone SA 1.00% 26/03/2025	301.439	1,95	EUR	100.000	Iberdrola International BV 2.63% Perp.	100.239	0,65
GBP	200.000	Orange SA FRN Perp.	251.586	1,63	EUR	200.000	ING Bank NV 0.75% 24/11/2020	203.801	1,32
EUR	100.000	Paprec Holding 5.25% 01/04/2022	102.774	0,67	EUR	95.000	Innogy Finance BV 1.25% 19/10/2027	94.100	0,61
EUR	300.000	RATP 0.88% 25/05/2027	302.567	1,96	EUR	100.000	Koninklijke KPN NV 0.63% 09/04/2025	96.583	0,63
EUR	100.000	Schneider Electric SE 1.84% 13/10/2025	106.817	0,69	EUR	100.000	Madrilena Red de Gas Finance BV 2.25% 11/04/2029	102.565	0,66
EUR	100.000	SNCF Reseau 2.25% 20/12/2047	110.795	0,72	EUR	100.000	Rabobank 0.13% 11/10/2021	99.799	0,65
EUR	300.000	Societe Generale SA 0.75% 25/11/2020	305.594	1,98	EUR	90.000	Roche Finance Europe BV 0.50% 27/02/2023	90.899	0,59
EUR	100.000	Unibail-Rodamco 1.00% 14/03/2025	100.691	0,65	EUR	200.000	TenneT Holding BV FRN Perp.	204.520	1,32
Summe Frankreich			3.674.097	23,80	EUR	300.000	Vonovia Finance BV FRN 08/04/2074	310.651	2,01
DEUTSCHLAND				Summe Niederlande			1.786.355	11,56	
EUR	225.000	Bayerische Landesbodenkreditanstalt 0.63% 22/11/2027	222.328	1,44					
EUR	200.000	Deutsche Apotheker- und Aerztebank 0.15% 07/03/2023	199.570	1,29					
EUR	100.000	Deutsche Wohnen AG 1.38% 24/07/2020	102.984	0,67					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond*

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					
NORWEGEN				FINNLAND					
EUR	100.000	Avinor AS 1.00% 29/04/2025	100.822	0,65	GBP	200.000	Municipality Finance plc 1.25% 07/12/2022	227.466	1,47
		Summe Norwegen	100.822	0,65			Summe Finnland	227.466	1,47
SPANIEN				FRANKREICH					
EUR	100.000	NorteGas Energia Distribucion 0.92% 28/09/2022	100.730	0,65	EUR	300.000	City of Paris France 1.38% 20/11/2034	304.832	1,97
		Summe Spanien	100.730	0,65	EUR	20.000	France (Govt of) OAT 1.75% 25/06/2039	21.584	0,14
SCHWEDEN				FRANKREICH (Region of)					
EUR	100.000	Akelius Residential 1.13% 14/03/2024	97.651	0,63	EUR	300.000	Ile de France (Region of) 3.63% 27/03/2024	359.168	2,33
EUR	200.000	Essity AB 1.13% 27/03/2024	202.624	1,31			Summe Frankreich	685.584	4,44
EUR	100.000	Nordea Bank AB 0.30% 30/06/2022	99.783	0,65	DEUTSCHLAND				
EUR	200.000	Skandinaviska Enskilda Banken 0.30% 17/02/2022	200.105	1,30	EUR	80.000	KfW 0.25% 30/06/2025	79.312	0,51
EUR	100.000	Swedbank AB 0.25% 07/11/2022	99.073	0,64	EUR	355.000	Landwirtschaftliche Rentenbank 0.25% 15/07/2024	353.898	2,30
		Summe Schweden	699.236	4,53	EUR	300.000	Nordrhein-Westfalen Land 0.95% 13/03/2028	304.072	1,97
VEREINIGTES KÖNIGREICH				DEUTSCHLAND (NRW)					
GBP	100.000	Anglian Water Services Financing plc 1.63% 10/08/2025	110.191	0,71	EUR	160.000	NRW. Bank 0.88% 10/11/2025	163.930	1,06
GBP	100.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	127.376	0,82			Summe Deutschland	901.212	5,84
USD	200.000	HSBC Holdings plc FRN 22/11/2023	158.957	1,03	ITALIEN				
EUR	200.000	Motability Operation 0.88% 14/03/2025	199.703	1,29	EUR	400.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 0.75% 21/11/2022	401.380	2,61
GBP	200.000	Nationwide Building Society FRN Perp.	238.228	1,54			Summe Italien	401.380	2,61
EUR	100.000	NGG Finance plc FRN 18/06/2076	107.733	0,70	NIEDERLANDE				
EUR	200.000	WellCome Trust Limited 1.13% 21/01/2027	203.347	1,32	EUR	225.000	Bank Nederlandse Gemeenten NV 0.05% 13/07/2024	220.832	1,43
		Summe Vereinigtes Königreich	1.145.535	7,41	EUR	175.000	Deutsche Bahn Finance BV 2.00% 20/02/2023	189.973	1,23
Summe Anleihen			10.119.587	65,54	EUR	300.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 0.25% 07/06/2024	298.449	1,93
							Summe Niederlande	709.254	4,59
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				POLEN					
BELGIEN				EUR	75.000	Poland (Govt of) 1.13% 07/08/2026	75.748	0,49	
EUR	160.000	Belgium (Govt of) 1.25% 22/04/2033	162.844	1,05			Summe Polen	75.748	0,49
EUR	200.000	Flemish Community 0.38% 13/10/2026	194.594	1,26					
		Summe Belgien	357.438	2,31					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Social Bond*

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				
SPANIEN				
EUR	380.000	Autonomous Community of Madrid 0.75% 30/04/2022	390.542	2,53
EUR	325.000	Instituto de Credito Oficial 0.10% 30/07/2021	327.553	2,13
		Summe Spanien	718.095	4,66
SUPRANATIONAL				
EUR	335.000	African Development Bank 0.25% 21/11/2024	331.155	2,14
EUR	350.000	Council of Europe 0.38% 27/03/2025	349.773	2,26
EUR	55.000	European Investment Bank 1.50% 15/11/2047	55.841	0,36
CAD	100.000	International Bank For Reconstruction & Development 2.25% 17/01/2023	62.782	0,41
USD	125.000	International Finance Corp. 1.75% 30/03/2020	100.386	0,65
EUR	40.000	Nordic Investment Bank 0.13% 10/06/2024	39.666	0,26
		Summe Supranational	939.603	6,08
		Summe supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente	5.015.780	32,49
		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	15.135.367	98,03
		Wert der Anlagen, insgesamt	15.135.367	98,03
(Gesamtkosten: EUR 15.204.436)				

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
AUSTRALIEN				FRANKREICH					
EUR	240.000	APT Pipelines Limited 2.00% 22/03/2027	246.741	0,30	EUR	155.000	Axa SA 3.25% 28/05/2049	157.238	0,19
GBP	400.000	Asciano Finance Limited 5.00% 19/09/2023	508.867	0,61	EUR	100.000	Credit Agricole SA FRN Perp.	112.337	0,13
AUD	250.000	Aurizon Network Pty Limited 4.00% 21/06/2024	157.197	0,19	EUR	225.000	Orange SA FRN Perp.	257.724	0,31
EUR	475.000	BHP Billiton Finance Limited FRN 22/10/2079	574.639	0,69	EUR	255.000	Paprec Holding 5.25% 01/04/2022	262.073	0,31
EUR	417.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	410.000	0,49	EUR	100.000	Paprec Holding SA 3.16% 31/03/2025	100.603	0,12
		Summe Australien	1.897.444	2,28	EUR	370.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	373.114	0,45
ÖSTERREICH				DEUTSCHLAND					
EUR	200.000	Bawag PSK 8.13% 30/10/2023	269.513	0,32	EUR	200.000	SFR Group SA 5.38% 15/05/2022	204.236	0,24
		Summe Österreich	269.513	0,32	EUR	100.000	Spie SA 3.13% 22/03/2024	101.079	0,12
BELGIEN				HONGKONG					
EUR	825.000	Anheuser-Busch Inbev SA 2.00% 23/01/2035	796.968	0,96	EUR	880.000	China National Chemical Corporation 1.75% 14/06/2022	877.929	1,05
		Summe Belgien	796.968	0,96			Summe Hongkong	877.929	1,05
KAIMANINSELN				ISLAND					
USD	433.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	334.711	0,40	EUR	486.000	Arion Banki Hf 1.63% 01/12/2021	504.326	0,60
USD	400.000	Sunny Optical Technology Group Company Limited 3.75% 23/01/2023	322.000	0,39			Summe Island	504.326	0,60
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 3.93% 19/01/2038	154.859	0,19					
		Summe Kaimaninseln	811.570	0,98					
DÄNEMARK									
EUR	325.000	ISS Global A/S 2.13% 02/12/2024	347.148	0,42					
		Summe Dänemark	347.148	0,42					
FINNLAND									
EUR	315.000	Sampo Oyj 1.25% 30/05/2025	316.037	0,38					
		Summe Finnland	316.037	0,38					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
NIEDERLANDE				SCHWEDEN					
EUR	185.000	Alliander NV FRN Perp.	183.955	0,22	EUR	425.000	Akelius Residential AB 3.88% 05/10/2078	425.295	0,51
EUR	186.000	Enexis Holding NV 1.50% 20/10/2023	194.848	0,23	EUR	1.175.000	Akelius Residential Property AB 1.75% 07/02/2025	1.172.756	1,40
EUR	400.000	Interxion Holding 6.00% 15/07/2020	413.014	0,48	EUR	290.000	Essity AB 1.13% 27/03/2024	293.805	0,35
EUR	344.000	LKQ Euro Holdings 3.63% 01/04/2026	346.174	0,41	Summe Schweden				
EUR	190.000	Madrikena Red de Gas Finance BV 2.25% 11/04/2029	194.873	0,23	1.891.856				
EUR	371.000	Stedin Holding NV 0.88% 24/10/2025	371.167	0,44	2,26				
EUR	204.000	Stedin Holding NV FRN Perp.	218.744	0,26	SCHWEIZ				
EUR	200.000	Telefonica Europe FRN Perp.	208.472	0,25	USD	250.000	Credit Suisse Group FRN 12/01/2029	197.083	0,24
EUR	100.000	Telefonica Europe BV FRN Perp.	107.460	0,13	USD	250.000	Credit Suisse Group AG 4.28% 09/01/2028	203.747	0,24
EUR	700.000	Telefonica Europe BV FRN Perp.	797.080	0,95	EUR	200.000	UBS AG FRN 12/02/2026	220.322	0,26
EUR	488.000	TenneT Holding BV FRN Perp.	499.029	0,60	Summe Schweiz				
EUR	150.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 0.38% 25/07/2020	146.085	0,17	621.152				
EUR	340.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.25% 15/04/2022	341.689	0,41	0,74				
USD	304.000	Teva Pharmaceuticals 1.70% 19/07/2019	238.841	0,28	VEREINIGTES KÖNIGREICH				
EUR	245.000	Vesteda Finance BV 1.75% 22/07/2019	249.560	0,30	EUR	830.000	Annington Funding plc 1.65% 12/07/2024	833.624	1,00
EUR	200.000	Vonovia Finance BV 1.25% 06/12/2024	200.572	0,24	GBP	390.000	Ardonagh Midco 3 Plc 8.38% 15/07/2023	457.387	0,55
EUR	400.000	Vonovia Finance BV 2.75% 22/03/2038	405.356	0,49	GBP	200.000	Arrow Global Finance 5.13% 15/09/2024	226.280	0,27
EUR	300.000	Vonovia Finance BV FRN Perp.	325.089	0,39	EUR	574.000	Barclays plc FRN 07/02/2028	568.544	0,68
EUR	400.000	Ziggo Bond Finance BV FRN 15/01/2025	403.237	0,48	GBP	410.000	Barclays plc 3.25% 17/01/2033	453.683	0,54
Summe Niederlande			5.845.245	6,96	GBP	200.000	Barclays plc FRN Perp.	248.767	0,30
SPANIEN					EUR	365.000	BAT International Finance plc 1.00% 23/05/2022	370.310	0,44
EUR	450.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	453.459	0,54	EUR	405.000	British Telecommunication 1.00% 21/11/2024	398.976	0,48
Summe Spanien			453.459	0,54	GBP	194.000	BUPA Finance plc 2.00% 05/04/2024	219.059	0,26
					GBP	143.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	182.148	0,22
					EUR	514.000	Cadent Finance plc 0.63% 22/09/2024	503.496	0,60
					GBP	100.000	Cadent Finance plc 2.13% 22/09/2028	108.075	0,13
					GBP	100.000	Cognita Financing plc 7.75% 15/08/2021	118.150	0,14
					GBP	100.000	Co-operative Group 6.88% 08/07/2020	124.152	0,15
					GBP	220.000	Cybg plc FRN 22/06/2025	251.006	0,30
					GBP	180.000	Cybg plc FRN 09/02/2026	213.325	0,26
					GBP	146.469	Delamare Finance plc 5.55% 19/02/2029	186.728	0,22
					EUR	717.000	DS Smith plc 1.38% 26/07/2024	717.497	0,87

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					
EUR	100.000	EC Finance plc 2.38% 15/11/2022	100.463	0,12	EUR	100.000	Thomas Cook Group plc 6.25% 15/06/2022	107.663	0,13
USD	579.045	Enquest plc 7.00% 15/04/2022	407.552	0,49	EUR	325.000	Virgin Media Finance plc 4.50% 15/01/2025	329.960	0,39
EUR	436.000	Experian Finance plc 1.38% 25/06/2026	433.897	0,52	GBP	700.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.88% 15/01/2027	788.904	0,95
GBP	550.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	769.170	0,92	GBP	454.000	Western Power Distribution 3.63% 06/11/2023	548.012	0,67
EUR	220.000	G4S International Finance plc 1.50% 09/01/2023	226.080	0,27			Summe Vereinigtes Königreich	17.228.028	20,61
EUR	220.000	G4S International Finance plc 1.50% 02/06/2024	222.134	0,27					
GBP	481.000	GKN Holdings plc 3.38% 12/05/2032	553.782	0,66	VEREINIGTE STAATEN				
GBP	350.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	441.023	0,53	EUR	300.000	American International Group Inc. 1.88% 21/06/2027	299.048	0,36
GBP	111.000	GKN Holdings plc 6.75% 28/10/2019	136.191	0,16	EUR	330.000	Avantor Inc. 4.75% 01/10/2024	329.199	0,39
USD	220.000	HSBC Holdings plc FRN Perp. 0.50% 27/07/2021	177.402	0,21	EUR	400.000	BAT Capital Corp. 1.13% 16/11/2023	402.348	0,49
EUR	150.000	Imperial Brands Finance plc 6.25% 04/12/2018	150.870	0,18	EUR	100.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 4.75% 15/12/2024	105.000	0,13
GBP	300.000	Imperial Tobacco Finance plc 6.25% 04/12/2018	353.689	0,42	EUR	100.000	Cemex Finance LLC 4.63% 15/06/2024	106.967	0,13
EUR	100.000	Ineos Finance plc 4.00% 01/05/2023	102.228	0,12	GBP	395.000	Digital Stout Holding LLC 3.30% 19/07/2029	454.733	0,54
GBP	315.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	340.659	0,41	GBP	407.000	Discovery Communications LLC 2.50% 20/09/2024	456.912	0,55
GBP	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.75% 24/01/2021	114.995	0,14	EUR	345.000	Equinix Inc. 2.88% 01/10/2025	332.708	0,40
GBP	325.000	Lloyds Banking Group plc 2.25% 16/10/2024	363.635	0,44	EUR	175.000	Equinix Inc. 2.88% 01/02/2026	167.242	0,20
GBP	200.000	Miller Homes 5.50% 15/10/2024	229.003	0,27	USD	80.000	Equinix Inc. 5.38% 15/05/2027	66.147	0,08
EUR	207.000	National Express Group plc FRN 15/05/2020	207.227	0,24	EUR	140.000	Iron Mountain Inc. 3.00% 15/01/2025	139.132	0,17
EUR	420.000	NGG Finance plc FRN 18/06/2076	452.479	0,54	EUR	250.000	Kinder Morgan Inc. 2.25% 16/03/2027	258.891	0,30
GBP	555.000	Pennon Group plc FRN Perp. 15/02/2025	635.967	0,76	EUR	200.000	Kraft Heinz Foods Company 2.00% 30/06/2023	210.370	0,25
GBP	150.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	172.150	0,20	EUR	100.000	Kronos International 3.75% 15/09/2025	102.847	0,12
GBP	580.000	Royal Bank of Scotland Group plc 2.88% 19/09/2026	662.073	0,79	EUR	196.000	Liberty Mutual Group 2.75% 04/05/2026	210.587	0,25
GBP	582.000	Severn Trent Water 3.63% 16/01/2026	717.749	0,86	EUR	405.000	Quintiles IMS Inc. 3.25% 15/03/2025	406.775	0,49
GBP	340.000	Shop Direct 7.75% 15/11/2022	336.579	0,39	EUR	300.000	Quintiles IMS Inc. 3.50% 15/10/2024	309.010	0,37
GBP	170.000	Telereal FRN 10/12/2033	203.357	0,24	EUR	200.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	203.922	0,24
EUR	121.000	Tesco Corporate Tsy Services plc 1.38% 01/07/2019	122.741	0,15	USD	180.000	Teva Pharmaceutical Finance IV LLC 2.25% 18/03/2020	138.852	0,17
GBP	481.473	Tesco Property Finance 4 plc 5.80% 13/10/2040	639.187	0,76	GBP	313.000	Vantiv LLC 3.88% 15/11/2025	353.203	0,42
					EUR	216.000	Verizon Communications Inc. 2.88% 15/01/2038	216.208	0,26
							Summe Vereinigte Staaten	5.270.101	6,31

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)						
Anleihen (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)						
BRITISCHE JUNGFERNINSELN				FRANKREICH						
EUR	485.000	Cheung Kong Infrastructure Holdings 1.00% 12/12/2024	480.560	0,58	EUR	2.665.000	France (Govt of) OAT 3.00% 25/04/2022	3.011.873	3,60	
GBP	200.000	Global Switch Holdings Limited 4.38% 13/12/2022	252.275	0,30	EUR	1.000	France (Govt of) OAT 3.50% 25/04/2026	1.248	0,00	
USD	410.000	State Grid Overseas Investment Limited 3.50% 04/05/2027	322.306	0,39			Summe Frankreich	3.013.121	3,60	
		Summe Britische Jungfernseln	1.055.141	1,27						
		Summe Anleihen	53.824.443	64,41						
Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen				DEUTSCHLAND						
LUXEMBURG				EUR 1.300				Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2026	1.266	0,00
EUR	64.286	Matterhorn Telecom FRN 01/02/2023	64.463	0,08	EUR	635.000	Germany (Govt of) 0.50% 15/02/2025	650.900	0,78	
		Summe Luxemburg	64.463	0,08	EUR	500.000	Germany (Govt of) Bundesobligation 1.00% 22/02/2019	507.560	0,61	
		Summe Forderungs- und hypothekenbesicherte Wertpapiere	64.463	0,08			Summe Deutschland	1.159.726	1,39	
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				UNGARN						
ARGENTINIEN				EUR 1.250.000				Hungary (Govt of) 3.88% 24/02/2020	1.346.584	1,61
USD	167.000	Argentina (Govt of) 7.50% 22/04/2026	145.385	0,17			Summe Ungarn	1.346.584	1,61	
USD	210.000	Cordoba (Provincia de) 7.45% 01/09/2024	180.191	0,22						
		Summe Argentinien	325.576	0,39						
ÖSTERREICH				ITALIEN						
EUR	200.000	Austria (Govt of) 1.50% 20/02/2047	205.444	0,25	EUR	1.925.000	Italy (Govt of) BPT 0.10% 15/04/2019	1.935.172	2,32	
		Summe Österreich	205.444	0,25	EUR	2.629.000	Italy (Govt of) BPT 2.20% 01/06/2027	2.747.938	3,29	
					EUR	2.130.000	Italy (Govt of) BPT 4.75% 01/09/2028	2.715.324	3,25	
							Summe Italien	7.398.434	8,86	
BELGIEN				ELFENBEINKÜSTE						
EUR	345.000	Belgium (Govt of) 1.60% 22/06/2047	350.427	0,42	USD	600.000	Ivory Coast (Govt of) 5.38% 23/07/2024	478.263	0,57	
		Summe Belgien	350.427	0,42			Summe Elfenbeinküste	478.263	0,57	
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				NIEDERLANDE						
USD	675.000	Dominican Republic (Govt of) 5.95% 25/01/2027	579.103	0,69	EUR	1.160.000	Netherlands (Govt of) 0.00% 15/01/2022	1.172.348	1,40	
		Summe Dominikanische Republik	579.103	0,69			Summe Niederlande	1.172.348	1,40	
ÄGYPTEN				OMAN						
USD	400.000	Egypt (Govt of) 7.50% 31/01/2027	353.095	0,42	USD	677.000	Oman (Govt of) 5.63% 17/01/2028	536.544	0,64	
		Summe Ägypten	353.095	0,42			Summe Oman	536.544	0,64	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt (Fortsetzung)			
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
SENEGAL				ITALIEN			
USD	560.000 Senegal (Govt of) 6.25% 30/07/2024	475.055	0,57	GBP	41.000 Acquedotto Pugliese SpA 6.92% 29/06/2018	47.420	0,06
	Summe Senegal	475.055	0,57		Summe Italien	47.420	0,06
SPANIEN				NIEDERLANDE			
EUR	1.800.000 Spain (Govt of) 0.25% 31/01/2019	1.810.314	2,17	USD	297.000 Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	250.015	0,30
	Summe Spanien	1.810.314	2,17		Summe Niederlande	250.015	0,30
VEREINIGTES KÖNIGREICH				PORTUGAL			
GBP	125.000 United Kingdom Gilt 0.50% 22/07/2022	139.642	0,17	EUR	100.000 Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2019	30.000	0,04
GBP	1.323.000 United Kingdom Treasury Bill 1.25% 22/07/2027	1.490.760	1,78		Summe Portugal	30.000	0,04
	Summe Vereinigtes Königreich	1.630.402	1,95		Summe Vereinigte Staaten	1.220.001	1,46
Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				VEREINIGTE STAATEN			
				USD	557.000 Broadcom Cayman Finance 3.63% 15/01/2024	445.956	0,53
				USD	800.000 Cott Holdings Inc. 5.50% 01/04/2025	643.620	0,77
				USD	167.000 Mplx LP 4.90% 15/04/2058	130.425	0,16
					Summe Vereinigte Staaten	1.220.001	1,46
				Summe Anleihen			
				2.264.578 2,72			
Aktien				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente			
LUXEMBURG				RUSSISCHE FÖDERATION			
	270.000 Aquila 3 SA 15/12/2021	278.043	0,33	RUB	262.471.000 Russia (Govt of) 7.50% 18/08/2021	3.835.255	4,59
	Summe Luxemburg	278.043	0,33		Summe Russische Föderation	3.835.255	4,59
Summe Aktien				Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente			
				3.835.255 4,59			
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt			
				75.001.385 89,75			
Anleihen				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt			
KANADA				Wert der Anlagen, insgesamt			
USD	456.000 Cenovus Energy Inc. 4.25% 15/04/2027	361.948	0,43	(Gesamtkosten: EUR 81.360.315)			
USD	105.000 Valeant Pharmaceuticals 6.50% 15/03/2022	88.204	0,11	6.099.833 7,31			
USD	114.000 Valeant Pharmaceuticals 7.00% 15/03/2024	96.750	0,12	81.101.218 97,06			
USD	215.000 Valeant Pharmaceuticals International Inc. 5.50% 01/11/2025	170.240	0,20				
	Summe Kanada	717.142	0,86				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
ARGENTINIEN				HONGKONG					
USD	580.000	YPF SA 8.50% 28/07/2025	640.178	1,46	USD	440.000	China National Chemical Corporation 4.63% 14/03/2023	442.909	1,01
Summe Argentinien			640.178	1,46	Summe Hongkong			442.909	1,01
BRASILIEN				INDIEN					
USD	425.000	Cemig Geracao e Transmissao SA 9.25% 05/12/2024	456.698	1,04	USD	440.000	HPCL - Mittal Energy Limited 5.25% 28/04/2027	421.575	0,97
USD	450.000	Itau Unibanco Holding FRN Perp.	440.662	1,01	USD	650.000	JSW Steel Limited 4.75% 12/11/2019	653.987	1,50
Summe Brasilien			897.360	2,05	Summe Indien			1.075.562	2,47
KANADA				INDONESIEN					
USD	500.000	First Quantum Minerals Limited 7.50% 01/04/2025	492.500	1,13	USD	380.000	Saka Energi Indonesia Pt 4.45% 05/05/2024	372.217	0,85
Summe Kanada			492.500	1,13	Summe Indonesien			372.217	0,85
KAIMANINSELN				IRLAND					
USD	500.000	Chn Aoyuan Property 6.35% 11/01/2020	504.806	1,15	USD	435.000	Alfa Bank via Alfa Bond Issuance plc FRN Perp.	429.693	0,98
USD	863.000	Comcel Trust 6.88% 06/02/2024	903.544	2,06	USD	780.000	Gazpromneft JSC 6.00% 27/11/2023	836.824	1,91
USD	430.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	431.720	0,99	Summe Irland			1.266.517	2,89
USD	242.000	Gran Tierra Energy 6.25% 15/02/2025	236.404	0,54	JERSEY - KANALINSELN				
USD	500.000	Grupo Aval Limited 4.75% 26/09/2022	502.837	1,15	USD	450.000	West China Cement Limited 6.50% 11/09/2019	460.783	1,05
USD	471.000	Vale Overseas Limited 6.25% 10/08/2026	527.713	1,21	Summe Jersey - Kanalinseln			460.783	1,05
Summe Kaimaninseln			3.107.024	7,10	LUXEMBURG				
KOLUMBIEN				MALAYSIA					
USD	400.000	Banco de Bogota SA 6.25% 12/05/2026	421.240	0,96	USD	442.000	Press Metal Labuan Limited 4.80% 30/10/2022	427.332	0,98
Summe Kolumbien			421.240	0,96	Summe Malaysia			427.332	0,98
CURACAO				LUXEMBURG					
USD	700.000	Teva Pharmaceutical Finance Company BV 2.95% 18/12/2022	621.023	1,42	USD	610.000	Evraz Group SA 6.50% 22/04/2020	638.711	1,46
Summe Curacao			621.023	1,42	USD	450.000	Gazprom OAO via Gaz Capital SA 6.00% 23/01/2021	473.408	1,08
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				LUXEMBURG					
USD	400.000	Banco de Reservas de la Republica Dominicana 7.00% 01/02/2023	420.167	0,96	USD	498.000	Hidrovias International Finance Sarl 5.95% 24/01/2025	494.202	1,13
Summe Dominikanische Republik			420.167	0,96	USD	884.000	MHP Lux SA 6.95% 03/04/2026	883.160	2,02
				LUXEMBURG					
					USD	740.000	MHP SA 8.25% 02/04/2020	808.771	1,85
					USD	1.380.000	MHP SE 7.75% 10/05/2024	1.457.349	3,33
					Summe Luxemburg			4.755.601	10,87

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
MAURITIUS				PERU			
USD	530.000 HTA Group Limited 9.13% 08/03/2022	564.318	1,29	USD	321.000 Cementos Pacasmayo 4.50% 08/02/2023	321.822	0,74
	Summe Mauritius	564.318	1,29	USD	500.000 Volcan Compania Minera SAA 5.38% 02/02/2022	516.974	1,18
MEXIKO				Summe Peru			
USD	270.000 Becle SAB de CV 3.75% 13/05/2025	265.864	0,61	838.796 1,92			
USD	500.000 Cemex SAB de CV 5.70% 11/01/2025	514.423	1,18	SINGAPUR			
USD	350.000 Elementia SAB de CV 5.50% 15/01/2025	353.500	0,80	USD	220.000 Geo Coal International Pte Limited 8.00% 04/10/2022	217.883	0,50
USD	464.000 Fermaca Enterprises S de RL de CV 6.38% 30/03/2038	499.960	1,14	USD	408.000 Golden Legacy Pte Limited 8.25% 07/06/2021	430.289	0,98
USD	840.000 Grupo Posadas SAB de CV 7.88% 30/06/2022	872.760	2,00	Summe Singapur			
	Summe Mexiko	2.506.507	5,73	648.172 1,48			
NIEDERLANDE				SÜDAFRIKA			
USD	480.000 Greenko Dutch BV 4.88% 24/07/2022	464.514	1,06	USD	250.000 Transnet SOC Limited 4.00% 26/07/2022	244.388	0,56
USD	275.000 Gth Finance BV 7.25% 26/04/2023	299.649	0,69	Summe Südafrika			
USD	840.000 Indo Energy Finance II BV 6.38% 24/01/2023	838.320	1,92	244.388 0,56			
USD	600.000 Kazmunaygas National Company JSC 7.00% 05/05/2020	644.940	1,47	TÜRKEI			
USD	1.097.000 Petrobras Global Finance BV 5.30% 27/01/2025	1.085.272	2,49	USD	750.000 Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii AS 3.38% 01/11/2022	704.221	1,61
USD	305.000 Petrobras Global Finance BV 5.75% 01/02/2029	294.989	0,67	USD	500.000 Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği AS 5.88% 12/08/2020	508.108	1,16
USD	456.000 Petrobras Global Finance BV 7.38% 17/01/2027	494.361	1,13	USD	494.000 Petkim Petrokimya Holding AS 5.88% 26/01/2023	483.193	1,11
USD	419.000 Petrobras Global Finance BV 8.38% 23/05/2021	476.774	1,09	Summe Türkei			
USD	208.000 Petrobras Global Finance BV 8.75% 23/05/2026	244.300	0,56	1.695.522 3,88			
USD	750.000 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 2.20% 21/07/2021	675.649	1,54	UKRAINE			
	Summe Niederlande	5.518.768	12,62	USD	200.000 Oschadbank 9.38% 10/03/2023	210.538	0,48
NIGERIA				Summe Ukraine			
USD	446.000 Seplat Petroleum 9.25% 01/04/2023	446.065	1,02	210.538 0,48			
	Summe Nigeria	446.065	1,02	VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE			
VEREINIGTES KÖNIGREICH				USD	530.000 DP World Limited 6.85% 02/07/2037	645.058	1,48
USD	500.000 Liquid Telecommunications Financing plc 8.50% 13/07/2022	526.250	1,20	Summe Vereinigte Arabische Emirate			
USD	428.000 Petra Diamonds US 7.25% 01/05/2022	429.278	0,98	645.058 1,48			
USD	425.000 Tullow Oil plc 6.25% 15/04/2022	429.250	0,98				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)						
Anleihen (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)						
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				ELFENBEINKÜSTE						
USD	200.000	Ukreximbank Via Biz Finance plc 9.63% 27/04/2022	211.070	0,48	USD	448.875	Ivory Coast (Govt of) FRN 31/12/2032	431.667	0,99	
USD	825.000	Vedanta Resources plc 6.38% 30/07/2022	841.809	1,92	EUR	358.000	Ivory Coast (Govt of) 6.63% 22/03/2048	442.835	1,01	
Summe Vereinigtes Königreich			2.437.657	5,56	Summe Elfenbeinküste			874.502	2,00	
VEREINIGTE STAATEN				KENIA						
USD	828.000	Cemex Finance LLC 6.00% 01/04/2024	858.026	1,96	USD	625.000	Kenya (Govt of) 7.25% 28/02/2028	654.072	1,50	
USD	995.000	Stillwater Mining Company 6.13% 27/06/2022	996.652	2,28	Summe Kenia			654.072	1,50	
Summe Vereinigte Staaten			1.854.678	4,24	RUSSISCHE FÖDERATION					
Summe Anleihen				33.010.880	75,46	RUB	71.700.000	Russia (Govt of) 8.15% 03/02/2027	1.354.141	3,10
Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen				Summe Russische Föderation				1.354.141	3,10	
VEREINIGTES KÖNIGREICH				SÜDAFRIKA						
USD	405.250	Dtek Finance plc 10.75% 31/12/2024	436.972	1,00	ZAR	2.575.000	South Africa (Govt of) 8.50% 31/01/2037	211.333	0,48	
Summe Vereinigtes Königreich			436.972	1,00	Summe Südafrika			211.333	0,48	
Summe Forderungs- und hypothekenbesicherte Wertpapiere				436.972	1,00	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				Aktien						
ARGENTINIEN				GEORGIEN						
USD	230.000	Buenos Aires (Provincia de) 9.13% 16/03/2024	256.979	0,59	440.000	Georgia Capital 09/03/2024	427.350	0,98		
USD	265.000	Cordoba (Provincia de) 7.13% 01/08/2027	263.499	0,60	Summe Georgien			427.350	0,98	
USD	625.000	Cordoba (Provincia de) 7.13% 10/06/2021	657.992	1,50	MEXIKO					
Summe Argentinien			1.178.470	2,69	437.000	Gruma SAB de CV 01/12/2024	455.711	1,04		
ÄGYPTEN				Summe Mexiko				455.711	1,04	
USD	320.000	Egypt (Govt of) 6.13% 31/01/2022	331.686	0,76	Summe Aktien			883.061	2,02	
Summe Ägypten			331.686	0,76	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind					
HONDURAS				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt						
USD	400.000	Honduras (Govt of) 6.25% 19/01/2027	424.667	0,97	Anleihen					
Summe Honduras			424.667	0,97	BRASILIEN					
Summe Brasilien				424.667	0,97	USD	400.000	Itau Unibanco 6.50% Perp.	396.000	0,91
Summe Brasilien				396.000	0,91	Summe Brasilien				
Summe Brasilien				396.000	0,91	Summe Brasilien				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)				
LUXEMBURG				
USD	446.000	Rumo Luxembourg Sarl 5.88% 18/01/2025	440.849	1,01
		Summe Luxemburg	440.849	1,01
VEREINIGTES KÖNIGREICH				
USD	455.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	455.285	1,04
		Summe Vereinigtes Königreich	455.285	1,04
VEREINIGTE STAATEN				
USD	209.000	Vrio 1 LLC 6.25% 04/04/2023	213.180	0,49
		Summe Vereinigte Staaten	213.180	0,49
		Summe Anleihen	1.505.314	3,45
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
ÄGYPTEN				
EGP	8.975.000	Egypt (Govt of) 0.00% 11/12/2018	454.167	1,04
		Summe Ägypten	454.167	1,04
		Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente	454.167	1,04
		Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt	1.959.481	4,49
		Wert der Anlagen, insgesamt	41.319.265	94,47
(Gesamtkosten: USD 40.886.402)				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
KAIMANINSELN				MEXIKO (Fortsetzung)					
USD	850.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	853.400	1,05	USD	688.000	Petroleos Mexicanos 6.50% 02/06/2041	686.029	0,84
USD	347.000	Gran Tierra Energy 6.25% 15/02/2025	338.976	0,42	USD	570.000	Petroleos Mexicanos 6.75% 21/09/2047	577.128	0,71
		Summe Kaimaninseln	1.192.376	1,47	USD	640.000	Unifin Financiera SAB de CV 7.00% 15/01/2025	628.160	0,77
KOLUMBIEN				Summe Mexiko					
USD	390.000	Ecopetrol SA 5.38% 26/06/2026	407.139	0,50			4.762.508	5,84	
USD	695.000	Ecopetrol SA 5.88% 28/05/2045	688.869	0,85					
		Summe Kolumbien	1.096.008	1,35	NIEDERLANDE				
ECUADOR				USD 600.000 Indo Energy Finance II BV 6.38% 24/01/2023				598.800	0,73
USD	398.000	Petroamazonas 4.63% 06/11/2020	379.095	0,47	USD	886.000	Kazakhstan Temir Zholy Finance BV 6.95% 10/07/2042	992.564	1,21
		Summe Ecuador	379.095	0,47	USD	1.400.000	Petrobras Global Finance BV 5.30% 27/01/2025	1.385.033	1,70
INDONESIEN				USD 500.000 Petrobras Global Finance BV 6.00% 27/01/2028				494.863	0,61
USD	598.000	Perusahaan Listrik Negara Pt 5.25% 24/10/2042	586.761	0,72	USD	733.000	Petrobras Global Finance BV 6.25% 17/03/2024	775.056	0,95
		Summe Indonesien	586.761	0,72	USD	300.000	Petrobras Global Finance BV 8.75% 23/05/2026	352.356	0,43
KASACHSTAN				Summe Niederlande					
USD	680.000	Kazakhstan Temir Zholy 4.85% 17/11/2027	680.515	0,84			4.598.672	5,63	
		Summe Kasachstan	680.515	0,84	RUSSISCHE FÖDERATION				
LUXEMBURG				USD 983.000 Gazprom Neft OAO via Gpn Capital SA 4.38% 19/09/2022				980.380	1,20
USD	404.000	Gaz Capital for Gazprom OAO 6.51% 07/03/2022	435.724	0,53			980.380	1,20	
USD	750.000	MHP Lux SA 6.95% 03/04/2026	749.288	0,92	SÜDAFRIKA				
		Summe Luxemburg	1.185.012	1,45	USD	680.000	Transnet SOC Limited 4.00% 26/07/2022	664.735	0,82
MEXIKO				Summe Südafrika					
USD	820.000	Grupo Posadas SAB de CV 7.88% 30/06/2022	851.980	1,05			664.735	0,82	
USD	504.000	Petroleos Mexicanos 3.50% 30/01/2023	482.341	0,59	TRINIDAD & TOBAGO				
USD	406.000	Petroleos Mexicanos 4.88% 18/01/2024	410.603	0,50	USD	797.000	Petroleum Company of Trinidad & Tobago Limited 9.75% 14/08/2019	840.336	1,03
USD	459.000	Petroleos Mexicanos 5.50% 27/06/2044	410.400	0,50			840.336	1,03	
USD	737.000	Petroleos Mexicanos 6.38% 23/01/2045	715.867	0,88	VEREINIGTES KÖNIGREICH				
					USD	810.000	Liquid Telecommunications Financing plc 8.50% 13/07/2022	852.525	1,05
					USD	440.000	Marb Bondco plc 7.00% 15/03/2024	415.016	0,51
							1.267.541	1,56	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					
ÄGYPTEN				JAMAICA					
USD	546.000	Egypt (Govt of) 6.59% 21/02/2028	555.701	0,68	USD	290.000	Jamaica (Govt of) 6.75% 28/04/2028	322.722	0,40
USD	467.000	Egypt (Govt of) 7.50% 31/01/2027	506.992	0,62	USD	200.000	Jamaica (Govt of) 8.00% 15/03/2039	240.113	0,29
USD	674.000	Egypt (Govt of) 7.90% 21/02/2048	710.787	0,87					
USD	845.000	Egypt (Govt of) 8.50% 31/01/2047	944.675	1,16					
		Summe Ägypten	2.718.155	3,33			Summe Jamaica	562.835	0,69
EL SALVADOR				KENIA					
USD	238.000	El Salvador (Govt of) 5.88% 30/01/2025	234.356	0,29	USD	245.000	Kenya (Govt of) 7.25% 28/02/2028	256.396	0,31
USD	474.000	El Salvador (Govt of) 8.25% 10/04/2032	534.435	0,66	USD	305.000	Kenya (Govt of) 8.25% 28/02/2048	326.909	0,40
		Summe El Salvador	768.791	0,95			Summe Kenia	583.305	0,71
HONDURAS				MEXIKO					
USD	470.000	Honduras (Govt of) 6.25% 19/01/2027	498.983	0,61	USD	344.000	Mexico (Govt of) 4.60% 23/01/2046	327.235	0,40
USD	965.000	Honduras (Govt of) 7.50% 15/03/2024	1.070.466	1,31	USD	767.000	Mexico (Govt of) 6.75% 27/09/2034	945.330	1,16
		Summe Honduras	1.569.449	1,92	MXN	320.000	Mexico (Govt of) Bonos 7.75% 23/11/2034	1.791.310	2,20
INDONESIEN				Summe Mexiko					
USD	463.000	Indonesia (Govt of) 4.63% 15/04/2043	454.941	0,56			3.063.875	3,76	
USD	634.000	Indonesia (Govt of) 5.25% 17/01/2042	669.031	0,82	NIGERIA				
USD	465.000	Indonesia (Govt of) 6.63% 17/02/2037	563.760	0,69	USD	400.000	Nigeria (Govt of) 6.50% 28/11/2027	406.653	0,50
USD	278.000	Indonesia (Govt of) 7.75% 17/01/2038	377.170	0,46	USD	842.000	Nigeria (Govt of) 7.88% 16/02/2032	918.969	1,13
		Summe Indonesien	2.064.902	2,53			Summe Nigeria	1.325.622	1,63
ELFENBEINKÜSTE				OMAN					
EUR	424.000	Ivory Coast (Govt of) 5.25% 22/03/2030	521.921	0,64	USD	1.248.000	Oman (Govt of) 5.63% 17/01/2028	1.216.420	1,49
USD	790.020	Ivory Coast (Govt of) FRN 31/12/2032	759.735	0,93	USD	684.000	Oman (Govt of) 6.75% 17/01/2048	660.094	0,81
USD	1.176.000	Ivory Coast (Govt of) 6.13% 15/06/2033	1.122.169	1,38			Summe Oman	1.876.514	2,30
EUR	544.000	Ivory Coast (Govt of) 6.63% 22/03/2048	672.911	0,83	PAKISTAN				
		Summe Elfenbeinküste	3.076.736	3,78	USD	970.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 15/04/2024	1.014.150	1,24
							Summe Pakistan	1.014.150	1,24

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)			
PARAGUAY				TÜRKEI			
USD	420.000 Paraguay (Govt of) 6.10% 11/08/2044	458.168	0,56	USD	1.490.000 Turkey (Govt of) 6.00% 25/03/2027	1.512.330	1,86
	Summe Paraguay	458.168	0,56	USD	585.000 Turkey (Govt of) 6.88% 17/03/2036	609.839	0,75
PERU				USD	619.000 Turkey (Govt of) 7.38% 05/02/2025	687.135	0,84
USD	188.000 Peruvian (Govt of) 5.63% 18/11/2050	227.358	0,28	USD	297.000 Turkey (Govt of) 8.00% 14/02/2034	343.899	0,42
	Summe Peru	227.358	0,28		Summe Türkei	3.153.203	3,87
RUSSISCHE FÖDERATION				UKRAINE			
USD	200.000 Russia (Govt of) 5.63% 04/04/2042	216.151	0,27	USD	479.000 Ukraine (Govt of) 7.38% 25/09/2032	463.373	0,57
RUB	144.000.000 Russia (Govt of) 7.05% 19/01/2028	2.525.099	3,10	USD	730.000 Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2024	750.230	0,92
	Summe Russische Föderation	2.741.250	3,37	USD	1.620.000 Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2026	1.662.830	2,04
SENEGAL					Summe Ukraine	2.876.433	3,53
USD	659.000 Senegal (Govt of) 6.25% 23/05/2033	649.916	0,80	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente			
	Summe Senegal	649.916	0,80			49.479.601	60,71
SERBIEN				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind			
USD	547.000 Serbia (Govt of) 5.88% 03/12/2018	557.682	0,68			70.871.059	86,96
	Summe Serbien	557.682	0,68	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt			
SÜDAFRIKA				Anleihen			
ZAR	39.700.000 South Africa (Govt of) 8.50% 31/01/2037	3.258.218	4,00	MEXIKO			
	Summe Südafrika	3.258.218	4,00	USD	420.000 Petroleos Mexicanos 4.63% 21/09/2023	420.950	0,52
SRI LANKA					Summe Mexiko	420.950	0,52
USD	320.000 Sri Lanka (Govt of) 6.20% 11/05/2027	315.726	0,39	VEREINIGTES KÖNIGREICH			
USD	640.000 Sri Lanka (Govt of) 6.85% 03/11/2025	664.805	0,82	USD	635.000 Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	635.397	0,78
	Summe Sri Lanka	980.531	1,21		Summe Vereinigtes Königreich	635.397	0,78
VEREINIGTE STAATEN				USD	610.000 Vrio 1 LLC 6.25% 04/04/2023	622.200	0,76
					Summe Vereinigte Staaten	622.200	0,76
				Summe Anleihen			
						1.678.547	2,06

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt (Fortsetzung)				Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				Anleihen					
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				VENEZUELA					
DOP	23.700.000	Dominican Republic (Govt of) 11.50% 10/05/2024	520.912	0,64	USD	946.402	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 16/05/2024	259.078	0,32
DOP	31.200.000	Dominican Republic (Govt of) 16.95% 04/02/2022	788.734	0,97	USD	2.349.683	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	634.109	0,78
Summe Dominikanische Republik				1.309.646	1,61	Summe Venezuela			
						893.187			
						1,10			
						Summe Anleihen			
						893.187			
						1,10			
						Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
						893.187			
						1,10			
						Wert der Anlagen, insgesamt			
						79.260.931			
						97,27			
						(Gesamtkosten: USD 80.228.967)			
ÄGYPTEN									
EGP	21.000.000	Egypt (Govt of) 0.00% 12/06/2018	1.148.903	1,41					
EGP	10.500.000	Egypt (Govt of) 0.00% 24/07/2018	563.247	0,69					
EGP	12.275.000	Egypt (Govt of) 0.00% 16/10/2018	634.252	0,78					
Summe Ägypten				2.346.402	2,88				
NIGERIA									
NGN	300.000.000	Nigeria (Govt of) 0.00% 17/01/2019	745.717	0,91					
Summe Nigeria				745.717	0,91				
PARAGUAY									
USD	340.000	Paraguay (Govt of) 5.60% 13/03/2048	350.515	0,43					
Summe Paraguay				350.515	0,43				
VENEZUELA									
USD	1.000.000	Venezuela (Govt of) 7.65% 21/04/2025	298.929	0,37					
USD	2.004.400	Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024	599.172	0,74					
USD	566.700	Venezuela (Govt of) 9.00% 07/05/2023	167.757	0,21					
Summe Venezuela				1.065.858	1,32				
Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				5.818.138	7,15				
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt				7.496.685	9,21				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

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

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
BERMUDAS				IRLAND					
USD	650.000	Kosmos Energy Limited 7.88% 01/08/2021	664.463	0,50	USD	1.420.000	Gtlk Europe Limited 5.95% 19/07/2021	1.459.015	1,10
Summe Bermudas			664.463	0,50	Summe Irland			1.459.015	1,10
KAIMANINSELN				JERSEY - KANALINSELN					
USD	1.290.000	Chn Aoyuan Property 6.35% 11/01/2020	1.302.400	0,99	USD	1.249.000	West China Cement Limited 6.50% 11/09/2019	1.278.929	0,97
USD	870.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	873.480	0,66	Summe Jersey - Kanalinseln			1.278.929	0,97
USD	801.000	Gran Tierra Energy 6.25% 15/02/2025	782.477	0,59	KASACHSTAN				
Summe Kaimaninseln			2.958.357	2,24	USD	1.400.000	Kazakhstan Temir Zholy 4.85% 17/11/2027	1.401.060	1,06
KOLUMBIEN				LUXEMBURG					
USD	1.390.000	Ecopetrol SA 5.88% 18/09/2023	1.489.038	1,13	USD	1.227.000	Evraz Group SA 6.50% 22/04/2020	1.284.751	0,97
Summe Kolumbien			1.489.038	1,13	USD	1.600.000	Gaz Capital SA 4.95% 19/07/2022	1.636.534	1,24
COSTA RICA				MEXIKO					
USD	400.000	Banco Nacional de Costa Rica 5.88% 25/04/2021	415.500	0,32	USD	1.615.000	Gazprom OAO via Gaz Capital SA 6.00% 23/01/2021	1.699.007	1,29
Summe Costa Rica			415.500	0,32	USD	1.250.000	MHP Lux SA 6.95% 03/04/2026	1.248.813	0,95
ECUADOR				Summe Luxemburg					
USD	429.000	Petroamazonas 4.63% 06/11/2020	408.623	0,31	USD	1.500.000	Sberbank of Russia via SB Capital SA 6.13% 07/02/2022	1.596.142	1,21
Summe Ecuador			408.623	0,31	Summe Mexiko			7.465.247	5,66
HONGKONG				UNGARN					
USD	1.320.000	China National Chemical Corporation 4.63% 14/03/2023	1.328.726	1,01	USD	630.000	Magyar Export-Import Bank Zrt 4.00% 30/01/2020	637.954	0,48
Summe Hongkong			1.328.726	1,01	Summe Ungarn			637.954	0,48
INDIEN				Summe Indien					
USD	1.935.000	JSW Steel Limited 4.75% 12/11/2019	1.946.871	1,48	Summe Indien			1.946.871	1,48

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

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

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)						
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)						
NIEDERLANDE				VEREINIGTES KÖNIGREICH						
USD	1.308.000	Indo Energy Finance II BV 6.38% 24/01/2023	1.305.384	0,99	USD	1.225.000	Liquid Telecommunications Financing plc 8.50% 13/07/2022	1.289.313	0,98	
USD	700.000	Kazmunaygas National Company JSC 6.38% 09/04/2021	754.653	0,57	USD	450.000	Marb Bondco plc 7.00% 15/03/2024	424.448	0,32	
USD	2.410.000	Kazmunaygas National Company JSC 7.00% 05/05/2020	2.590.506	1,96	USD	630.000	Petra Diamonds US 7.25% 01/05/2022	631.881	0,48	
USD	634.000	Kazmunaygas National Company JSC 9.13% 02/07/2018	643.630	0,49	USD	1.623.000	Ukreximbank Via Biz Finance plc 9.63% 27/04/2022	1.712.833	1,30	
USD	610.000	Listrindo Capital BV 4.95% 14/09/2026	579.232	0,44	Summe Vereinigtes Königreich			4.058.475	3,08	
USD	2.669.000	Petrobras Global Finance BV 5.30% 27/01/2025	2.640.468	2,00	VEREINIGTE STAATEN					
USD	500.000	Petrobras Global Finance BV 6.13% 17/01/2022	534.875	0,41	USD	620.000	Cemex Finance LLC 6.00% 01/04/2024	642.483	0,49	
Summe Niederlande				9.048.748	6,86	Summe Vereinigte Staaten			642.483	0,49
RUSSISCHE FÖDERATION				BRITISCHE JUNGFERNINSELN						
USD	915.000	Gazprom Neft OAO via Gpn Capital SA 4.38% 19/09/2022	912.563	0,69	USD	900.000	Beijing Gas Singapore Capital Corp. 2.75% 31/05/2022	868.080	0,66	
Summe Russische Föderation				912.563	0,69	USD	900.000	China Southern Power Grid International Finance BVI Company Limited 2.75% 08/05/2022	877.930	0,67
SÜDAFRIKA				Summe Britische Jungferninseln						
USD	2.005.000	Transnet SOC Limited 4.00% 26/07/2022	1.959.991	1,49	USD	900.000	Proven Glory Capital 3.25% 21/02/2022	879.274	0,67	
Summe Südafrika				1.959.991	1,49	USD	860.000	Sinopec Group Overseas Development 3.90% 17/05/2022	871.355	0,66
SRI LANKA				Summe Britische Jungferninseln						
USD	2.099.000	National Savings Bank 8.88% 18/09/2018	2.140.891	1,62	USD	820.000	Sinopec Grp Oversea 2013 4.38% 17/10/2023	843.429	0,64	
Summe Sri Lanka				2.140.891	1,62	USD	1.750.000	State Grid Overseas Investment Limited 2.75% 04/05/2022	1.706.406	1,29
THAILAND				Summe Britische Jungferninseln						
USD	1.293.000	PTT Exploration & Production pcl FRN Perp.	1.299.021	0,99	USD	1.200.000	Studio City Company Limited 7.25% 30/11/2021	1.259.625	0,96	
Summe Thailand				1.299.021	0,99	Summe Britische Jungferninseln			7.306.099	5,55
UKRAINE				Summe Anleihen						
USD	1.000.000	Oschadbank 9.38% 10/03/2023	1.052.688	0,80	Summe Anleihen				60.431.264	45,83
USD	500.000	Oschadbank 9.63% 20/03/2025	531.172	0,40	Summe Anleihen				60.431.264	45,83
Summe Ukraine				1.583.860	1,20					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

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

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					
ARGENTINIEN				ECUADOR					
USD	710.000	Argentina (Govt of) 5.88% 11/01/2028	670.151	0,51	USD	690.000	Ecuador (Govt of) 10.75% 28/03/2022	766.662	0,58
USD	1.700.000	Argentina (Govt of) 6.88% 26/01/2027	1.736.027	1,32		Summe Ecuador	766.662	0,58	
USD	1.518.000	Argentina (Govt of) 7.50% 22/04/2026	1.625.272	1,23					
USD	1.237.097	Buenos Aires (Provincia de) 9.95% 09/06/2021	1.382.085	1,05					
USD	1.438.000	Cordoba (Provincia de) 7.13% 01/08/2027	1.429.855	1,08					
USD	946.000	Cordoba (Provincia de) 7.45% 01/09/2024	998.290	0,76					
USD	330.000	Cordoba (Provincia de) 7.13% 10/06/2021	347.420	0,26					
		Summe Argentinien	8.189.100	6,21					
WEISSRUSSLAND				ÄGYPTEN					
USD	1.607.000	Belarus (Govt of) 6.88% 28/02/2023	1.705.538	1,29	USD	1.815.000	Egypt (Govt of) 5.58% 21/02/2023	1.844.944	1,40
		Summe Weißrussland	1.705.538	1,29	USD	2.798.000	Egypt (Govt of) 6.13% 31/01/2022	2.900.177	2,20
					USD	626.000	Egypt (Govt of) 6.59% 21/02/2028	637.123	0,48
						Summe Ägypten	5.382.244	4,08	
					EL SALVADOR				
					USD	881.000	El Salvador (Govt of) 7.38% 01/12/2019	923.467	0,70
						Summe El Salvador	923.467	0,70	
					HONDURAS				
					USD	602.000	Honduras (Govt of) 7.50% 15/03/2024	667.794	0,51
						Summe Honduras	667.794	0,51	
					UNGARN				
					USD	1.000.000	Hungary (Govt of) 6.38% 29/03/2021	1.089.746	0,83
						Summe Ungarn	1.089.746	0,83	
					INDONESIEN				
					USD	1.818.000	Indonesia (Govt of) 3.75% 25/04/2022	1.824.052	1,38
					USD	2.359.000	Perusahaan Penerbit 3.40% 29/03/2022	2.336.806	1,77
						Summe Indonesien	4.160.858	3,15	
					ELFENBEINKÜSTE				
					USD	1.580.000	Ivory Coast (Govt of) 5.38% 23/07/2024	1.548.906	1,17
					USD	1.085.805	Ivory Coast (Govt of) FRN 31/12/2032	1.044.181	0,79
						Summe Elfenbeinküste	2.593.087	1,96	
					DOMINIKANISCHE REPUBLIK				
					USD	2.300.000	Dominican Republic (Govt of) 5.88% 18/04/2024	2.418.795	1,83
					DOP	20.000.000	Dominican Republic (Govt of) 8.90% 15/02/2023	412.993	0,31
						Summe Dominikanische Republik	2.831.788	2,14	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

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

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					
KENIA				SENEGAL					
USD	280.000	Kenya (Govt of) 7.25% 28/02/2028	293.024	0,22	USD	1.443.000	Senegal (Govt of) 6.25% 30/07/2024	1.505.479	1,14
	Summe Kenia	293.024	0,22	USD	304.000	Senegal (Govt of) 8.75% 13/05/2021	342.724	0,26	
MEXIKO				Summe Senegal					
MXN	167.000	Mexico (Govt of) Bonos 6.50% 10/06/2021	896.857	0,68		1.848.203	1,40		
	Summe Mexiko	896.857	0,68	SERBIEN					
NIGERIA				USD	1.265.000	Serbia (Govt of) 4.88% 25/02/2020	1.296.931	0,98	
USD	1.610.000	Nigeria (Govt of) 6.50% 28/11/2027	1.636.778	1,24	USD	1.500.000	Serbia (Govt of) 7.25% 28/09/2021	1.669.854	1,27
	Summe Nigeria	1.636.778	1,24	Summe Serbien					
OMAN				ZAR	36.920.000	South Africa (Govt of) 10.50% 21/12/2026	3.599.687	2,74	
USD	1.080.000	Oman (Govt of) 3.63% 15/06/2021	1.054.023	0,81	Summe Südafrika				
USD	859.000	Oman (Govt of) 3.88% 08/03/2022	835.670	0,63	3.599.687				
USD	2.220.000	Oman (Govt of) 4.13% 17/01/2023	2.136.939	1,62	SRI LANKA				
	Summe Oman	4.026.632	3,06	USD	1.100.000	Sri Lanka (Govt of) 5.88% 25/07/2022	1.119.360	0,85	
PAKISTAN				USD	200.000	Sri Lanka (Govt of) 6.25% 27/07/2021	207.863	0,16	
USD	420.000	Pakistan (Govt of) 6.75% 03/12/2019	429.841	0,33	Summe Sri Lanka				
USD	700.000	Third Pakistan International Sukuk Company Limited 5.50% 13/10/2021	691.775	0,52	1.327.223				
	Summe Pakistan	1.121.616	0,85	TÜRKEI					
PARAGUAY				USD	1.014.000	Export Credit Bank 5.00% 23/09/2021	1.006.541	0,76	
USD	966.000	Paraguay (Govt of) 4.63% 25/01/2023	997.395	0,76	USD	900.000	Export Credit Bank of Turkey 5.38% 08/02/2021	908.001	0,69
	Summe Paraguay	997.395	0,76	USD	1.200.000	Turkey (Govt of) 6.25% 26/09/2022	1.272.026	0,96	
RUSSISCHE FÖDERATION				Summe Türkei					
RUB	145.000.000	Russia (Govt of) 7.05% 19/01/2028	2.542.636	1,93	3.186.568				
	Summe Russische Föderation	2.542.636	1,93	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente					
				56.480.802					
				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind					
				116.912.066					
				88,66					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

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

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt				Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					
Anleihen				Anleihen					
VEREINIGTES KÖNIGREICH				VENEZUELA					
USD	1.035.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	1.035.647	0,79	USD	488.861	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 16/05/2024	133.826	0,10
Summe Vereinigtes Königreich			1.035.647	0,79	USD	491.751	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	132.709	0,10
VEREINIGTE STAATEN				Summe Venezuela					
USD	1.021.000	Vrio 1 LLC 6.25% 04/04/2023	1.041.420	0,79	266.535 0,20				
Summe Vereinigte Staaten			1.041.420	0,79	Summe Anleihen				
Summe Anleihen			2.077.067	1,58	266.535 0,20				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldsinstrumente				Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				Wert der Anlagen, insgesamt					
DOP	35.900.000	Dominican Republic (Govt of) 11.50% 10/05/2024	789.061	0,60	124.484.525 94,41				
DOP	25.170.000	Dominican Republic (Govt of) 15.50% 01/06/2018	511.107	0,39	(Gesamtkosten: USD 124.905.283)				
Summe Dominikanische Republik			1.300.168	0,99					
ÄGYPTEN									
EGP	24.000.000	Egypt (Govt of) 0.00% 24/07/2018	1.287.422	0,98					
EGP	19.475.000	Egypt (Govt of) 0.00% 16/10/2018	1.006.278	0,76					
Summe Ägypten			2.293.700	1,74					
NIGERIA									
NGN	330.000.000	Nigeria (Govt of) 0.00% 17/01/2019	820.289	0,62					
Summe Nigeria			820.289	0,62					
VENEZUELA									
USD	1.480.000	Venezuela (Govt of) 7.65% 21/04/2025	442.414	0,34					
USD	1.245.400	Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024	372.286	0,28					
Summe Venezuela			814.700	0,62					
Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldsinstrumente				Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					
			5.228.857	3,97					
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt				Wert der Anlagen, insgesamt					
			7.305.924	5,55					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
BERMUDAS				NIEDERLANDE					
USD	998.000	Aircastle Limited 5.50% 15/02/2022	1.042.988	0,35	USD	300.000	Constellium NV 5.75% 15/05/2024	296.108	0,10
USD	96.000	Weatherford Bermuda 7.75% 15/06/2021	90.327	0,03	USD	140.000	Schaeffler Finance BV 4.75% 15/05/2023	141.721	0,05
USD	255.000	Weatherford Bermuda 7.75% 15/06/2021	239.932	0,08	USD	1.280.000	Ziggo Bond Finance BV 6.00% 15/01/2027	1.201.126	0,41
USD	260.000	Weatherford International Limited 8.25% 15/06/2023	226.875	0,08			Summe Niederlande	1.638.955	0,56
		Summe Bermudas	1.600.122	0,54			VEREINIGTES KÖNIGREICH		
KANADA									
USD	2.629.000	Teck Resources Limited 6.25% 15/07/2041	2.796.598	0,95	USD	404.000	International Game Tech 6.25% 15/02/2022	423.948	0,14
		Summe Kanada	2.796.598	0,95	USD	1.517.000	Virgin Media Finance plc 5.75% 15/01/2025	1.460.113	0,49
FRANKREICH									
USD	3.226.000	SFR Group SA 7.38% 01/05/2026	3.080.830	1,04	USD	1.025.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/01/2026	990.406	0,33
USD	563.000	SPCM SA 4.88% 15/09/2025	547.518	0,18	USD	329.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.50% 15/08/2026	320.568	0,11
		Summe Frankreich	3.628.348	1,22			Summe Vereinigtes Königreich	3.195.035	1,07
DEUTSCHLAND									
USD	1.294.000	Unitymedia Hessen GmbH & Company 5.00% 15/01/2025	1.323.374	0,45	VEREINIGTE STAATEN				
USD	1.441.000	Unitymedia Kabelbw GmbH 6.13% 15/01/2025	1.511.249	0,51	USD	10.000	Acadia Healthcare Company 5.63% 15/02/2023	10.163	0,00
		Summe Deutschland	2.834.623	0,96	USD	229.000	AES Corp. 4.50% 15/03/2023	233.454	0,08
IRLAND									
USD	830.000	Ardagh Packaging Finance 4.63% 15/05/2023	834.844	0,28	USD	400.000	AES Corp. 4.88% 15/05/2023	407.353	0,14
		Summe Irland	834.844	0,28	USD	462.000	AES Corp. 5.13% 01/09/2027	471.312	0,16
ITALIEN									
USD	909.000	Telecom Italia SpA 5.30% 30/05/2024	933.429	0,31	USD	177.000	AES Corp. 6.00% 15/05/2026	186.846	0,06
USD	1.151.000	Wind Tre SpA 5.00% 20/01/2026	979.443	0,33	USD	567.000	Ally Financial Inc. 4.13% 13/02/2022	565.535	0,19
		Summe Italien	1.912.872	0,64	USD	173.000	Ally Financial Inc. 4.63% 19/05/2022	175.857	0,06
LUXEMBURG									
USD	810.000	Ineos Group Holdings 5.63% 01/08/2024	819.630	0,28	USD	1.205.000	Ally Financial Inc. 5.13% 30/09/2024	1.236.084	0,42
USD	1.324.000	Telecom Italia Capital SA 6.00% 30/09/2034	1.376.563	0,46	USD	538.000	Antero Resources Corp. 5.63% 01/06/2023	549.433	0,19
		Summe Luxemburg	2.196.193	0,74	USD	231.000	APX Group Inc. 8.75% 01/12/2020	232.877	0,08
					USD	672.000	Asbury Automotive Group 6.00% 15/12/2024	684.600	0,23
					USD	181.000	B&G Foods Inc. 4.63% 01/06/2021	179.586	0,06
					USD	1.644.000	B&G Foods Inc. 5.25% 01/04/2025	1.533.030	0,52
					USD	486.000	Ball Corp. 4.38% 15/12/2020	495.948	0,17
					USD	185.000	Berry Plastics Corp. 5.13% 15/07/2023	187.198	0,06
					USD	1.405.000	Berry Plastics Corp. 5.13% 15/07/2023	1.421.691	0,48
					USD	448.000	Berry Plastics Corp. 5.50% 15/05/2022	460.040	0,16

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					
USD	977.000	Boyd Gaming Corp. 6.38% 01/04/2026	1.019.851	0,34	USD	27.000	Frontier Communications Corp. 6.88% 15/01/2025	16.065	0,01
USD	809.000	Boyd Gaming Corp. 6.88% 15/05/2023	854.001	0,29	USD	1.296.000	Frontier Communications Corp. 7.13% 15/01/2023	880.727	0,30
USD	607.000	Callon Petroleum Company 6.13% 01/10/2024	623.116	0,21	USD	11.000	Frontier Communications Corp. 7.63% 15/04/2024	6.889	0,00
USD	502.000	Calpine Corp. 5.25% 01/06/2026	485.058	0,16	USD	47.000	Group 1 Automotive Inc. 5.00% 01/06/2022	47.457	0,02
USD	150.000	Calpine Corp. 5.50% 01/02/2024	137.712	0,05	USD	560.000	HCA Inc. 4.50% 15/02/2027	541.748	0,18
USD	653.000	Calpine Corp. 5.75% 15/01/2025	598.340	0,20	USD	756.000	HCA Inc. 4.75% 01/05/2023	764.826	0,26
USD	853.000	Carrizo Oil & Gas Inc. 6.25% 15/04/2023	857.511	0,28	USD	655.000	HCA Inc. 5.00% 15/03/2024	663.269	0,22
USD	241.000	CCO Holdings LLC 5.75% 15/01/2024	245.157	0,08	USD	3.155.000	HCA Inc. 5.25% 15/04/2025	3.227.014	1,10
USD	150.000	Cedar Fair LP 5.38% 01/06/2024	152.438	0,05	USD	428.000	HCA Inc. 5.25% 15/06/2026	434.671	0,15
USD	183.000	Centene Corp. 4.75% 15/05/2022	185.545	0,06	USD	547.000	Icahn Enterprises LP 6.25% 01/02/2022	556.914	0,19
USD	941.000	Centene Corp. 4.75% 15/01/2025	918.098	0,31	USD	851.000	Istar Inc. 6.00% 01/04/2022	856.167	0,29
USD	525.000	Centene Corp. 6.13% 15/02/2024	547.680	0,18	USD	383.000	L Brands Inc. 5.25% 01/02/2028	361.217	0,12
USD	15.000	Centurylink Inc. 5.63% 01/04/2025	13.603	0,00	USD	755.000	L Brands Inc. 6.88% 01/11/2035	733.294	0,25
USD	1.356.000	Centurylink Inc. 7.50% 01/04/2024	1.367.865	0,46	USD	68.000	Laredo Petroleum Inc. 5.63% 15/01/2022	67.490	0,02
USD	275.000	CenturyLink Inc. 5.80% 15/03/2022	268.641	0,09	USD	879.000	Laredo Petroleum Inc. 6.25% 15/03/2023	883.738	0,29
USD	1.098.000	Chemours 7.00% 15/05/2025	1.187.945	0,40	USD	2.084.000	Lennar Corp. 4.50% 30/04/2024	2.049.222	0,69
USD	16.000	Chemours Company 6.63% 15/05/2023	16.820	0,01	USD	119.000	Lennar Corp. 4.75% 01/04/2021	121.225	0,04
USD	41.000	CIT Group Inc. 5.38% 15/05/2020	42.428	0,01	USD	581.000	Match Group Inc. 6.38% 01/06/2024	619.854	0,21
USD	1.230.000	Community Health Systems (CHS) 6.25% 31/03/2023	1.133.906	0,38	USD	700.000	Meritage Homes Corp. 5.13% 06/06/2027	664.344	0,22
USD	473.000	Community Health Systems (CHS) 6.88% 01/02/2022	275.523	0,09	USD	507.000	Meritage Homes Corp. 6.00% 01/06/2025	521.019	0,18
USD	851.000	Davita Healthcare Partners Inc. 5.75% 15/08/2022	873.485	0,29	USD	312.000	Meritage Homes Corp. 7.00% 01/04/2022	342.030	0,12
USD	1.260.000	DaVita Healthcare Partners Inc. 5.13% 15/07/2024	1.232.901	0,42	USD	207.000	MGM Growth Properties 4.50% 01/09/2026	198.332	0,07
USD	246.000	Diamond Offshore 7.88% 15/08/2025	247.322	0,08	USD	158.000	MGM Growth Properties 5.63% 01/05/2024	163.333	0,06
USD	302.000	Dish DBS Corp. 5.88% 15/11/2024	270.101	0,09	USD	868.000	MGM Resorts International 4.63% 01/09/2026	830.873	0,28
USD	555.000	Dynegy Inc. 7.63% 01/11/2024	598.887	0,20	USD	1.111.000	MGM Resorts International 6.00% 15/03/2023	1.167.147	0,39
USD	405.000	Energy Transfer Equity LP 4.25% 15/03/2023	394.369	0,13	USD	434.000	MGM Resorts International 6.75% 01/10/2020	461.668	0,16
USD	2.597.000	Energy Transfer Equity LP 5.50% 01/06/2027	2.607.202	0,88	USD	211.000	MSCI Inc. 4.75% 01/08/2026	209.220	0,07
USD	954.000	Equinix Inc. 5.38% 15/05/2027	970.112	0,33	USD	825.000	Navient Corp. 5.50% 25/01/2023	812.625	0,27
USD	1.171.000	Equinix Inc. 5.88% 15/01/2026	1.222.231	0,41	USD	865.000	Navient Corp. 6.50% 15/06/2022	894.243	0,30
USD	145.000	Freeport-Mcmoran Copper & Gold Inc. 3.55% 01/03/2022	140.559	0,05	USD	200.000	Navient Corp. 6.63% 26/07/2021	208.125	0,07
USD	1.157.000	Freeport-Mcmoran Inc. 4.55% 14/11/2024	1.139.600	0,38	USD	51.000	Navient Corp. 8.00% 25/03/2020	54.332	0,02
USD	2.220.000	Freeport-McMoran Inc. 5.45% 15/03/2043	2.047.285	0,69	USD	289.000	Navient LLC 7.25% 25/01/2022	306.882	0,10
					USD	1.616.000	Netflix Inc. 4.38% 15/11/2026	1.531.443	0,51
					USD	1.293.000	Netflix Inc. 5.75% 01/03/2024	1.349.211	0,46

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					
USD	144.000	Nrg Energy Inc. 6.25% 01/05/2024	148.798	0,05	USD	616.000	Tenet Healthcare Corp. 6.75% 15/06/2023	604.835	0,20
USD	764.000	NRG Energy Inc. 6.63% 15/01/2027	783.492	0,26	USD	998.000	T-Mobile USA Inc. 5.38% 15/04/2027	1.008.604	0,34
USD	322.000	NRG Energy Inc. 7.25% 15/05/2026	341.675	0,12	USD	2.118.000	T-Mobile USA Inc. 6.50% 15/01/2026	2.251.698	0,77
USD	452.000	NRG Yield Operating LLC 5.00% 15/09/2026	446.224	0,15	USD	112.000	Transdigm Inc. 6.00% 15/07/2022	114.398	0,04
USD	1.076.000	NRG Yield Operating LLC 5.38% 15/08/2024	1.080.820	0,36	USD	1.490.000	Transdigm Inc. 6.38% 15/06/2026	1.508.625	0,51
USD	266.000	Olin Corp. 5.00% 01/02/2030	255.028	0,09	USD	2.302.000	Transdigm Inc. 6.50% 15/05/2025	2.332.214	0,78
USD	723.000	Olin Corp. 5.13% 15/09/2027	713.264	0,24	USD	696.000	Transmontaigne Partners LP 6.13% 15/02/2026	699.109	0,24
USD	1.577.000	Outfront Media Cap LLC 5.88% 15/03/2025	1.598.683	0,54	USD	1.200.000	United Rentals North 5.88% 15/09/2026	1.250.785	0,43
USD	332.000	Penske Automotive Group Inc. 3.75% 15/08/2020	330.990	0,11	USD	191.000	United Rentals North America 4.63% 15/10/2025	186.243	0,06
USD	615.000	Penske Automotive Group Inc. 5.38% 01/12/2024	619.613	0,21	USD	1.049.000	United Rentals North America 4.88% 15/01/2028	1.013.596	0,34
USD	250.000	Penske Automotive Group Inc. 5.50% 15/05/2026	246.269	0,08	USD	506.000	United Rentals North America Inc. 5.50% 15/05/2027	512.769	0,17
USD	620.000	Pinnacle Foods Finance LLC 5.88% 15/01/2024	642.475	0,22	USD	545.000	Verisign Inc. 4.63% 01/05/2023	546.117	0,18
USD	584.372	Reynolds Group Holdings 5.75% 15/10/2020	592.056	0,20	USD	169.000	Welbilt Inc. 9.50% 15/02/2024	188.676	0,06
USD	445.000	Rowan Companies Inc. 4.75% 15/01/2024	371.575	0,13	USD	1.480.000	Wellcare Health Plans 5.25% 01/04/2025	1.489.250	0,50
USD	1.523.000	RSP Permian inc. 5.25% 15/01/2025	1.581.064	0,54	USD	843.000	Wesco Distribution 5.38% 15/06/2024	847.215	0,29
USD	1.315.000	Scientific Games Corp. 10.00% 01/12/2022	1.416.912	0,48	USD	998.000	Williams Companies Inc. 3.70% 15/01/2023	970.555	0,33
USD	978.000	Scotts Miracle-Gro Company 5.25% 15/12/2026	970.054	0,33	USD	751.000	WPX Energy Inc. 5.25% 15/09/2024	741.613	0,25
USD	663.000	Scotts Miracle-Gro Company 6.00% 15/10/2023	696.461	0,23	USD	1.310.000	WPX Energy Inc. 6.00% 15/01/2022	1.350.610	0,45
USD	156.000	SM Energy Company 5.63% 01/06/2025	148.005	0,05	USD	1.231.000	Zayo Group LLC 6.38% 15/05/2025	1.276.393	0,43
USD	1.891.000	SM Energy Company 6.75% 15/09/2026	1.879.181	0,64			Summe Vereinigte Staaten	95.787.264	32,30
USD	1.265.000	Spectrum Brands Inc. 5.75% 15/07/2025	1.293.606	0,43	Summe Anleihen			116.424.854	39,26
USD	181.000	Spectrum Brands Inc. 6.63% 15/11/2022	187.699	0,06	Aktien				
USD	454.000	Springleaf Finance Corp. 5.63% 15/03/2023	446.339	0,15	DEUTSCHLAND				
USD	1.855.000	Sprint Corp. 7.13% 15/06/2024	1.810.944	0,61		1.803.000	IHO Verwaltungs GmbH 15/09/2023	1.751.164	0,59
USD	2.068.000	Sprint Corp. 7.63% 15/02/2025	2.036.979	0,69			Summe Deutschland	1.751.164	0,59
USD	718.000	Sprint Corp. 7.63% 01/03/2026	701.396	0,24	Summe Aktien			1.751.164	0,59
USD	373.000	Starwood Property Trust 5.00% 15/12/2021	381.159	0,13	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind			118.176.018	39,85
USD	853.000	Teleflex Inc. 4.63% 15/11/2027	823.891	0,28					
USD	97.000	Teleflex Inc. 4.88% 01/06/2026	96.394	0,03					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
BERMUDAS				KAIMANINSELN					
USD	315.000	Viking Cruises Limited 5.88% 15/09/2027	299.119	0,11	USD	865.000	Avolon Holdings Funding 5.50% 15/01/2023	856.086	0,29
		Summe Bermudas	299.119	0,11	USD	322.000	Transocean Inc. 7.50% 15/01/2026	318.754	0,11
KANADA				Summe Kaimaninseln					
USD	410.000	Bombardier Inc. 6.13% 15/01/2023	409.873	0,14			1.174.840	0,40	
USD	767.000	Bombardier Inc. 7.50% 01/12/2024	795.433	0,27	IRLAND				
USD	60.000	Bombardier Inc. 7.50% 15/03/2025	61.759	0,02	USD	1.481.000	Ardagh Packaging Finance 6.00% 15/02/2025	1.490.256	0,50
USD	596.000	Bombardier Inc. 8.75% 01/12/2021	655.824	0,22	USD	828.000	Ardagh Packaging Finance 7.25% 15/05/2024	881.820	0,30
USD	141.000	Hudbay Minerals Inc. 7.25% 15/01/2023	147.188	0,05			Summe Irland	2.372.076	0,80
USD	687.000	Hudbay Minerals Inc. 7.63% 15/01/2025	731.945	0,25	JERSEY - KANALINSELN				
USD	282.000	MDC Partners Inc. 6.50% 01/05/2024	276.337	0,09	USD	1.063.000	Delphi Jersey Holdings 5.00% 01/10/2025	1.020.290	0,34
USD	1.162.000	New Red Finance Inc. 4.25% 15/05/2024	1.111.266	0,37			Summe Jersey - Kanalinseln	1.020.290	0,34
USD	490.000	New Red Finance Inc. 4.63% 15/01/2022	492.513	0,17	LUXEMBURG				
USD	600.000	Quebecor Media Inc. 5.75% 15/01/2023	618.000	0,21	USD	884.000	Camelot Finance SA 7.88% 15/10/2024	924.977	0,31
USD	1.147.000	Ritchie Bros Auctioneers Inc. 5.38% 15/01/2025	1.149.151	0,40	USD	1.096.000	Fage International 5.63% 15/08/2026	1.025.369	0,35
USD	384.000	Teck Resources Limited 8.50% 01/06/2024	428.134	0,14	USD	832.000	Nielsen Company Luxembourg Sarl 5.00% 01/02/2025	824.389	0,28
USD	996.000	Valeant Pharmaceuticals 7.00% 15/03/2024	1.039.575	0,35	USD	425.000	Nielsen Company Luxembourg Sarl 5.50% 01/10/2021	431.375	0,15
USD	525.000	Valeant Pharmaceuticals International Inc. 5.50% 01/11/2025	511.250	0,17			Summe Luxemburg	3.206.110	1,09
USD	69.000	Valeant Pharmaceuticals International Inc. P.P. 144A 5.63% 01/12/2021	66.068	0,02	NIEDERLANDE				
USD	894.000	Valeant Pharmaceuticals International Inc. P.P. 144A 5.88% 15/05/2023	792.866	0,27	USD	640.000	Alcoa Nederland Holding BV 7.00% 30/09/2026	691.600	0,23
USD	1.999.000	Valeant Pharmaceuticals International Inc. P.P. 144A 6.13% 15/04/2025	1.720.390	0,58	USD	917.000	Alpha 3 BV 6.25% 01/02/2025	930.755	0,31
USD	707.000	Videotron Limited 5.00% 15/07/2022	720.875	0,24	USD	602.000	Constellium NV 5.88% 15/02/2026	594.475	0,20
		Summe Kanada	11.728.447	3,96	USD	908.000	Constellium NV 6.63% 01/03/2025	923.474	0,31
					USD	1.740.000	Ziggo Secured Finance 5.50% 15/01/2027	1.637.269	0,55
							Summe Niederlande	4.777.573	1,60
					VEREINIGTES KÖNIGREICH				
					USD	2.055.000	International Game Tech P.P. 144A 6.50% 15/02/2025	2.212.335	0,76
					USD	171.000	Sensata Technologies UK Financing 6.25% 15/02/2026	180.140	0,06
							Summe Vereinigtes Königreich	2.392.475	0,82

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
USD	974.000 ABC Supply Company Inc. 5.75% 15/12/2023	1.007.089	0,34	USD	385.000 Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.13% 30/06/2027	383.460	0,13
USD	1.097.000 Acadia Healthcare Company 6.50% 01/03/2024	1.146.365	0,38	USD	295.000 Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 7.00% 30/06/2024	326.897	0,11
USD	480.000 Altice US Finance I Corp. P.P. 144A 5.38% 15/07/2023	487.440	0,16	USD	844.000 Chobani LLC 7.50% 15/04/2025	871.216	0,29
USD	917.000 Altice USA Finance 5.50% 15/05/2026	895.794	0,30	USD	217.000 CIT Group Inc. 5.25% 07/03/2025	222.304	0,08
USD	434.000 APX Group 7.63% 01/09/2023	450.275	0,15	USD	505.000 Core & Main 6.13% 15/08/2025	496.152	0,17
USD	830.000 APX Group Inc. 7.88% 01/12/2022	865.275	0,29	USD	1.179.000 Crownrock LP 5.63% 15/10/2025	1.169.210	0,39
USD	234.000 Ascend Learning LLC 6.88% 01/08/2025	241.057	0,08	USD	730.000 CSC Holdings LLC P.P. 144A 6.63% 15/10/2025	756.919	0,26
USD	1.087.000 Avis Budget Car Rental LLC 5.25% 15/03/2025	1.040.803	0,35	USD	157.000 CSC Holdings LLC P.P. 144A 10.13% 15/01/2023	174.466	0,06
USD	353.000 Axalta Coating System Limited 4.88% 15/08/2024	354.544	0,12	USD	1.661.000 CSC Holdings LLC P.P. 144A 10.88% 15/10/2025	1.953.178	0,66
USD	828.000 Beacon Escrow Corp. 4.88% 01/11/2025	789.705	0,26	USD	313.000 Cyrusone LP 5.00% 15/03/2024	314.193	0,11
USD	739.000 Beacon Roofing Supply 6.38% 01/10/2023	778.259	0,26	USD	1.464.000 Cyrusone LP 5.38% 15/03/2027	1.466.259	0,49
USD	651.000 Big River Steel 7.25% 01/09/2025	681.968	0,23	USD	508.000 Delek Logistics Partners LP 6.75% 15/05/2025	513.715	0,17
USD	407.000 Boyne USA Inc. 7.25% 01/05/2025	418.447	0,14	USD	148.000 Diamondback Energy Inc. 4.75% 01/11/2024	146.705	0,05
USD	825.000 Catalent Pharma Solutions Inc. 4.88% 15/01/2026	812.823	0,27	USD	1.545.000 Diamondback Energy Inc. 5.38% 31/05/2025	1.569.617	0,53
USD	563.000 CCO Holdings LCC 5.13% 01/05/2027	534.456	0,18	USD	3.720.000 DISH DBS Corp. 7.75% 01/07/2026	3.513.074	1,20
USD	881.000 CCO Holdings LLC 5.00% 01/02/2028	827.039	0,29	USD	1.133.000 Dynegy Inc. 8.13% 30/01/2026	1.251.965	0,42
USD	681.000 CCO Holdings LLC 5.50% 01/05/2026	667.426	0,23	USD	974.000 Eldorado Resorts Inc. 6.00% 01/04/2025	989.219	0,33
USD	63.000 CCO Holdings LLC 5.75% 15/02/2026	62.725	0,02	USD	139.000 Endeavor Energy Resources LP 5.50% 30/01/2026	138.484	0,05
USD	779.000 CCO Holdings LLC 5.88% 01/04/2024	794.789	0,27	USD	794.000 Endeavor Energy Resources LP 5.75% 30/01/2028	791.347	0,26
USD	607.000 CDK Global Inc. 4.88% 01/06/2027	584.996	0,20	USD	819.000 Envision Healthcare Corp. 6.25% 01/12/2024	847.665	0,29
USD	831.000 Centennial Resource Production LLC 5.38% 15/01/2026	817.991	0,28	USD	577.000 Extraction Oil & Gas 5.63% 01/02/2026	549.348	0,19
USD	897.000 Cequel Com Holding 7.50% 01/04/2028	919.425	0,31	USD	453.000 Extraction Oil & Gas 7.38% 15/05/2024	475.367	0,16
USD	69.000 Cequel Communications Holdings P.P. 144A 5.13% 15/12/2021	69.000	0,02	USD	352.000 First Data Corp 5.00% 15/01/2024	352.409	0,12
USD	691.000 Cequel Communications Holdings P.P. 144A 5.13% 15/12/2021	691.000	0,23	USD	1.380.000 First Data Corp P.P. 144A 5.75% 15/01/2024	1.392.075	0,47
USD	1.067.000 Change Healthcare Holdings LLC 5.75% 01/03/2025	1.058.107	0,35	USD	1.379.000 First Data Corp P.P. 144A 7.00% 01/12/2023	1.450.535	0,49
				USD	203.000 First Data Corp. P.P. 144A 5.38% 15/08/2023	206.746	0,07
				USD	186.000 Flex Acquisition Company Inc. 6.88% 15/01/2025	185.535	0,06
				USD	450.000 Frontier Communications 8.50% 01/04/2026	437.063	0,15
				USD	2.738.000 Gartner Inc. 5.13% 01/04/2025	2.738.000	0,92

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					
USD	891.000	Gates Global LLC P.P. 144A 6.00% 15/07/2022	906.593	0,31	USD	298.000	Lennar Corp. 6.25% 15/12/2021	315.135	0,11
USD	111.000	Gibraltar Industries Inc. 6.25% 01/02/2021	113.128	0,04	USD	440.000	Lithia Motors Inc. 5.25% 01/08/2025	443.984	0,15
USD	37.000	GLP Capital LP 5.38% 01/11/2023	38.573	0,01	USD	261.000	Live Nation Entertainment 5.63% 15/03/2026	264.884	0,09
USD	2.093.000	GLP Capital LP 5.38% 15/04/2026	2.138.020	0,73	USD	401.000	Live Nation Entertainment Inc. 4.88% 01/11/2024	391.543	0,13
USD	548.000	Grinding Media Inc. 7.38% 15/12/2023	578.140	0,20	USD	469.000	Match Group Inc. 5.00% 15/12/2027	462.551	0,16
USD	29.000	Group 1 Automotive Inc. 5.25% 15/12/2023	29.077	0,01	USD	591.000	Mattel Inc. 6.75% 31/12/2025	578.190	0,20
USD	290.000	H&E Equipment Services 5.63% 01/09/2025	292.998	0,10	USD	1.384.000	MGM Growth Properties 4.50% 15/01/2028	1.303.555	0,44
USD	1.015.000	Halcon Resources Corp. 6.75% 15/02/2025	999.775	0,34	USD	155.000	Molina Healthcare Inc. 4.88% 15/06/2025	145.048	0,05
USD	536.000	Halcon Resources Corp. 6.75% 15/02/2025	527.960	0,18	USD	886.000	MPH Acquisition Holdings LLC 7.13% 01/06/2024	916.104	0,31
USD	212.000	Hanesbrands Inc. 4.63% 15/05/2024	208.577	0,07	USD	287.000	MSCI Inc. 5.75% 15/08/2025	300.188	0,10
USD	911.000	HD Supply Inc. 5.75% 15/04/2024	961.516	0,32	USD	1.330.000	Multi-Color Corp. 4.88% 01/11/2025	1.251.031	0,42
USD	1.035.000	Hertz Corp. 7.63% 01/06/2022	1.052.650	0,36	USD	1.646.000	Nabors Industries Inc. 5.75% 01/02/2025	1.555.470	0,52
USD	1.588.000	Holly Energy Partners 6.00% 01/08/2024	1.621.719	0,55	USD	1.522.000	Netflix Inc. 4.88% 15/04/2028	1.477.291	0,50
USD	1.028.000	Hologic Inc 4.38% 15/10/2025	993.305	0,34	USD	1.527.000	NextEra Energy Operating Partners 4.50% 15/09/2027	1.451.392	0,50
USD	325.000	Hologic Inc. 4.63% 01/02/2028	312.532	0,11	USD	840.000	NFP Corp. 6.88% 15/07/2025	836.850	0,28
USD	866.000	Hub International Limited P.P. 144A 7.88% 01/10/2021	897.609	0,30	USD	263.000	NGPL Pipeco LLC 4.38% 15/08/2022	262.014	0,09
USD	569.000	Indigo Natural Resources 6.88% 15/02/2026	542.399	0,18	USD	620.000	NGPL Pipeco LLC 4.88% 15/08/2027	614.194	0,21
USD	491.000	Informatica LLC P.P. 144A 7.13% 15/07/2023	489.773	0,17	USD	302.000	NGPL PipeCo LLC 7.77% 15/12/2037	367.610	0,12
USD	896.000	Interval Acquisition 5.63% 15/04/2023	917.280	0,31	USD	952.000	Novelis Corp. 5.88% 30/09/2026	938.910	0,32
USD	348.000	IRB Holding 6.75% 15/02/2026	341.510	0,12	USD	551.000	Novelis Corp. 6.25% 15/08/2024	564.431	0,19
USD	230.000	Iron Mountain Inc. 4.88% 15/09/2027	214.156	0,07	USD	339.000	NRG Energy Inc. 5.75% 15/01/2028	332.962	0,11
USD	1.573.000	Iron Mountain Inc. 5.25% 15/03/2028	1.480.400	0,49	USD	672.000	Owens-Brockway 5.88% 15/08/2023	697.116	0,24
USD	725.000	Jaguar Holding Company 6.38% 01/08/2023	735.648	0,25	USD	560.000	Owens-Brockway 6.38% 15/08/2025	594.750	0,20
USD	770.000	Kar Auction Services Inc. 5.13% 01/06/2025	767.113	0,26	USD	387.000	Parsley Energy 6.25% 01/06/2024	401.478	0,14
USD	1.261.000	KFC Holding-Pizza Hut Holdings LLC-Taco Bell America LLC 5.25% 01/06/2026	1.258.636	0,42	USD	1.628.000	Parsley Energy LLC 5.25% 15/08/2025	1.616.345	0,54
USD	805.000	Koppers Inc. 6.00% 15/02/2025	822.469	0,28	USD	246.000	Parsley Energy LLC 5.38% 15/01/2025	245.383	0,08
USD	206.000	Lamb Weston Holdings Inc. 4.63% 01/11/2024	205.743	0,07	USD	823.000	Parsley Energy LLC 5.63% 15/10/2027	821.958	0,28
USD	1.004.000	Lamb Weston Holdings Inc. 4.88% 01/11/2026	997.474	0,34	USD	738.000	Pattern Energy Group Inc. 5.88% 01/02/2024	759.218	0,26
USD	128.000	Lennar Corp. 4.75% 29/11/2027	123.303	0,04	USD	710.000	Pdc Energy Inc. 6.13% 15/09/2024	726.461	0,25
USD	480.000	Lennar Corp. 5.00% 15/06/2027	472.200	0,16					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
USD	788.000 PDC Energy Inc. 5.75% 15/05/2026	779.299	0,26	USD	426.000 Springs Industries Inc. 6.25% 01/06/2021	433.189	0,15
USD	793.000 Penn National Gaming Inc. 5.63% 15/01/2027	764.492	0,26	USD	1.062.000 Sprint Communications Inc. P.P. 144A 7.00% 01/03/2020	1.115.764	0,38
USD	1.047.000 Platform Specialty Products Corp. 5.88% 01/12/2025	1.025.406	0,35	USD	245.000 Steel Dynamics Inc. 4.13% 15/09/2025	234.287	0,08
USD	410.000 Platform Specialty Products Corp. P.P. 144A 6.50% 01/02/2022	417.944	0,14	USD	584.000 Sterigenics-Nordion Holdings LLC 6.50% 15/05/2023	589.772	0,20
USD	521.000 Polaris Intermedia 8.50% 01/12/2022	532.397	0,18	USD	297.000 Sunoco LP 4.88% 15/01/2023	287.756	0,10
USD	1.189.000 Post Holdings Inc. 5.00% 15/08/2026	1.131.036	0,38	USD	511.000 Sunoco LP 5.50% 15/02/2026	493.115	0,17
USD	2.788.000 Post Holdings Inc. 5.75% 01/03/2027	2.777.545	0,93	USD	691.000 Sunoco LP 5.88% 15/03/2028	672.059	0,23
USD	600.000 PQ Corp. 5.75% 15/12/2022	595.773	0,20	USD	2.717.000 Symantec Corp. 5.00% 15/04/2025	2.744.413	0,93
USD	1.259.000 PQ Corp. 6.75% 15/11/2022	1.326.670	0,44	USD	175.000 Tallgrass Energy Partners 5.50% 15/09/2024	178.969	0,06
USD	1.067.000 Prestige Brands Inc. 6.38% 01/03/2024	1.095.009	0,37	USD	1.505.000 Tallgrass Energy Partners 5.50% 15/01/2028	1.517.228	0,51
USD	1.517.000 Qualitytech LP 4.75% 15/11/2025	1.425.980	0,48	USD	2.107.000 Targa Resources 5.38% 01/02/2027	2.103.333	0,71
USD	1.117.000 Quicken Loans Inc. P.P. 144A 5.75% 01/05/2025	1.123.516	0,38	USD	302.000 Targa Resources Partners LP 4.25% 15/11/2023	290.274	0,10
USD	270.000 Quintiles IMS Inc. 5.00% 15/10/2026	270.006	0,09	USD	1.405.000 Targa Resources Partners LP 5.00% 15/01/2028	1.347.044	0,45
USD	408.000 Quintiles Transnational Corp. P.P. 144A 4.88% 15/05/2023	417.060	0,14	USD	645.000 Taylor Morrison 5.88% 15/04/2023	661.634	0,22
USD	314.000 Radiate Holdco 6.88% 15/02/2023	303.795	0,10	USD	383.000 Taylor Morrison Communities Inc. P.P. 144A 5.25% 15/04/2021	386.560	0,13
USD	712.000 Radiate Holdco LLC 6.63% 15/02/2025	664.385	0,22	USD	891.000 Tenet Healthcare Corp. 4.63% 15/07/2024	856.474	0,29
USD	2.388.000 Reynolds Group Issuer Inc. 5.13% 15/07/2023	2.414.150	0,81	USD	611.000 Tenet Healthcare Corp. 5.13% 01/05/2025	589.233	0,20
USD	774.000 Reynolds Group Issuer Inc. 7.00% 15/07/2024	810.281	0,27	USD	492.000 Tenet Healthcare Corp. 7.00% 01/08/2025	484.928	0,16
USD	506.000 Rivers Pittsburgh LP 6.13% 15/08/2021	488.898	0,16	USD	1.702.000 Terraform Power Operating LLC 5.00% 31/01/2028	1.625.603	0,55
USD	750.000 SBA Communications 4.88% 15/07/2022	757.406	0,25	USD	546.000 T-Mobile USA Inc. 4.50% 01/02/2026	524.160	0,18
USD	2.216.000 SBA Communications 4.88% 01/09/2024	2.179.990	0,73	USD	683.000 T-Mobile USA Inc. 4.75% 01/02/2028	657.388	0,22
USD	1.442.000 Scientific Games International Inc. 5.00% 15/10/2025	1.414.424	0,48	USD	102.000 Trimas Corp. 4.88% 15/10/2025	98.975	0,03
USD	436.000 Sesi LLC 7.75% 15/09/2024	452.350	0,15	USD	425.000 USA Compression Partners 6.88% 01/04/2026	432.305	0,15
USD	470.000 Sirius XM Radio Inc. 5.00% 01/08/2027	442.681	0,15	USD	630.000 Valeant Pharmaceuticals International Inc. P.P. 144A 5.50% 01/03/2023	553.219	0,19
USD	1.592.000 Sirius XM Radio Inc. P.P. 144A 5.38% 15/04/2025	1.582.050	0,53	USD	650.000 Valeant Pharmaceuticals International Inc. 9.25% 01/04/2026	648.375	0,22
USD	781.000 Sirius XM Radio Inc. 5.38% 15/07/2026	773.678	0,26	USD	1.114.000 Valvoline Inc. 5.50% 15/07/2024	1.145.389	0,39
USD	710.000 Springleaf Finance Corp. 6.88% 15/03/2025	713.224	0,24	USD	1.233.000 VeriSign Inc. 4.75% 15/07/2027	1.182.909	0,40

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt (Fortsetzung)				Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN			
USD	195.000 Vhf Parent LLC 6.75% 15/06/2022	206.578	0,07	USD	216.000 American Builders & Contractors Supply Company Inc. P.P. 144A 5.63% 15/04/2021	219.303	0,07
USD	116.000 Weatherford International LLC 9.88% 01/03/2025	104.828	0,04	USD	372.000 Aruba Investments Inc. P.P. 144A 8.75% 15/02/2023	385.950	0,13
USD	510.000 Whiting Petroleum 6.63% 15/01/2026	514.463	0,17	USD	269.000 Charles River Laborato 5.50% 01/04/2026	273.539	0,09
USD	587.000 Wynn Las Vegas LLC 5.25% 15/05/2027	576.614	0,19	USD	405.000 Microsemi Corp. 9.13% 15/04/2023	451.539	0,15
USD	849.000 Wynn Las Vegas LLC 5.50% 01/03/2025	854.306	0,29	USD	1.152.000 Provident Funding Associates LP 6.38% 15/06/2025	1.157.760	0,39
USD	311.000 Zayo Group LLC 5.75% 15/01/2027	304.197	0,10	USD	886.000 Tempo Acquisition LLC 6.75% 01/06/2025	886.554	0,30
USD	905.000 Zekelman Industries 9.88% 15/06/2023	998.139	0,34	USD	34.429 Tunica-Biloxi Gaming 3.78% 15/12/2020	9.468	0,00
	Summe Vereinigte Staaten	136.449.168	46,06	USD	400.000 Wyndham Hotels & Resorts 5.38% 15/04/2026	400.000	0,13
Summe Anleihen		163.420.098	55,18		Summe Vereinigte Staaten	3.784.113	1,26
Aktien				Summe Anleihen			
VEREINIGTE STAATEN				Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
	94.000 Cco Holdings LLC P.P. 144A 01/05/2027	93.811	0,03	4.421.113 1,47			
	1.111.000 CCO Holdings LLC 01/05/2025	1.097.607	0,37	Wert der Anlagen, insgesamt			
	327.000 Diamondback Energy Inc. 31/05/2025	331.496	0,11	288.920.018 97,48			
	1.330.000 Lennar Corp. 15/11/2024	1.379.875	0,47	(Gesamtkosten: USD 293.089.534)			
	Summe Vereinigte Staaten	2.902.789	0,98				
Summe Aktien		2.902.789	0,98				
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt							
		166.322.887	56,16				
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente							
Anleihen							
KANADA							
USD	637.000 Rockpoint Gas Storage 7.00% 31/03/2023	637.000	0,21				
	Summe Kanada	637.000	0,21				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					
USD	27.000	Enterprise Products Operating LLC 5.10% 15/02/2045	29.405	0,49	USD	25.000	Molson Coors Brewing Company 4.20% 15/07/2046	23.668	0,39
USD	5.000	Eversource Energy 2.75% 15/03/2022	4.902	0,08	USD	16.000	Mplx LP 4.70% 15/04/2048	15.700	0,26
USD	35.000	Express Scripts Holding Company 4.80% 15/07/2046	35.697	0,59	USD	5.000	Newell Brands Inc. 5.50% 01/04/2046	5.290	0,09
USD	20.000	Express Scripts Holding Company 2.60% 30/11/2020	19.666	0,33	USD	46.000	Nisource Finance Corp. 4.38% 15/05/2047	46.369	0,77
USD	30.000	Fedex Corp. 4.55% 01/04/2046	30.503	0,51	USD	3.000	Nisource Finance Corp. 5.25% 15/02/2043	3.350	0,06
USD	25.000	Ford Motor Company 5.29% 08/12/2046	24.465	0,41	USD	15.000	Noble Energy Inc. 5.25% 15/11/2043	16.143	0,27
USD	60.000	General Electric Company 4.13% 09/10/2042	55.882	0,93	USD	43.000	Northrop Grumman Corp. 4.03% 15/10/2047	41.500	0,69
USD	18.000	Gilead Sciences Inc. 4.15% 01/03/2047	17.852	0,30	USD	13.000	Oracle Corp. 4.00% 15/07/2046	12.864	0,21
USD	103.000	Goldman Sachs Group Inc. FRN 23/04/2029	101.034	1,67	USD	13.000	Oracle Corp. 4.00% 15/11/2047	12.844	0,21
USD	22.000	Hess Corp 5.80% 01/04/2047	23.180	0,38	USD	45.000	Pacific Gas & Electric Company 3.75% 15/02/2024	45.185	0,75
USD	38.000	Indiana Michigan Power Company 3.75% 01/07/2047	36.101	0,60	USD	5.000	PepsiCo Inc. 1.50% 22/02/2019	4.961	0,08
USD	47.000	JPMorgan Chase & Company 2.95% 01/10/2026	44.311	0,74	USD	30.000	PG&E Corp. 3.30% 15/03/2027	28.608	0,47
USD	15.000	JPMorgan Chase & Company FRN 23/01/2029	14.572	0,24	USD	37.000	Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	33.072	0,55
USD	26.000	JPMorgan Chase & Company FRN 23/01/2049	24.839	0,41	USD	115.000	Public Service Electric & Gas Company 3.00% 15/05/2027	110.803	1,84
USD	2.000	Kellogg Company 3.25% 21/05/2018	2.002	0,03	USD	69.000	Sempra Energy Corp. 3.55% 15/06/2024	68.703	1,13
USD	54.000	Kinder Morgan Inc. 5.05% 15/02/2046	53.050	0,87	USD	11.000	Simon Property Group LP 3.38% 01/12/2027	10.574	0,18
USD	42.000	Kraft Heinz Foods Company 4.38% 01/06/2046	38.460	0,64	USD	43.000	Southern Company 4.40% 01/07/2046	43.102	0,72
USD	24.000	Kroger Company 4.45% 01/02/2047	22.652	0,38	USD	16.000	Sunoco Logistics Partners Operations LP 5.40% 01/10/2047	15.306	0,25
USD	13.000	Kroger Company 4.65% 15/01/2048	12.643	0,21	USD	43.000	Sysco Corp. 2.50% 15/07/2021	42.242	0,70
USD	107.000	Lockheed Martin Corp. 1.85% 23/11/2018	106.514	1,77	USD	20.000	Sysco Corp. 3.25% 15/07/2027	19.179	0,32
USD	20.000	Lowe's Companies Inc. 2.50% 15/04/2026	18.561	0,31	USD	6.000	Target Corp. 3.63% 15/04/2046	5.483	0,09
USD	17.000	McDonald's Corp. 4.88% 09/12/2045	18.483	0,31	USD	5.000	Target Corp. 3.90% 15/11/2047	4.779	0,08
USD	21.000	Microsoft Corp. 1.00% 01/05/2018	20.977	0,35	USD	12.000	Time Warner Cable Inc. 4.50% 15/09/2042	10.512	0,17
USD	30.000	Microsoft Corp. 3.70% 08/08/2046	29.565	0,49	USD	13.000	Time Warner Inc. 5.35% 15/12/2043	13.881	0,23
USD	10.000	Microsoft Corp. 4.25% 06/02/2047	10.802	0,18	USD	45.000	Tyson Foods Inc. 2.65% 15/08/2019	44.785	0,75
USD	38.000	Molson Coors Brewing Company 3.00% 15/07/2026	35.213	0,59	USD	5.000	Tyson Foods Inc. 4.55% 02/06/2047	5.009	0,08
					USD	41.000	United Parcel Service Inc. 2.05% 01/04/2021	40.107	0,66
					USD	12.000	United Parcel Service Inc. 3.75% 15/11/2047	11.553	0,19
					USD	16.000	United Technologies Corp. 3.75% 01/11/2046	14.500	0,24
					USD	36.000	UnitedHealth Group Inc. 1.95% 15/10/2020	35.172	0,58

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens				
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)							
Anleihen (Fortsetzung)				Aktien							
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN							
USD	31.000	UnitedHealth Group Inc. 3.75% 15/10/2047	29.380	0,49	100.000	Eversource Energy 01/05/2018	99.898	1,66			
USD	65.000	Verizon Communications Inc. 4.67% 15/03/2055	61.932	1,03	6.000	Qualcomm Inc. 20/05/2047	5.828	0,10			
USD	33.000	Voya Financial Inc. 4.80% 15/06/2046	33.904	0,56	Summe Vereinigte Staaten			105.726	1,76		
USD	36.000	Wal-Mart Stores Inc. 1.75% 09/10/2019	35.631	0,59	Summe Aktien			105.726	1,76		
USD	30.000	Wec Energy Group Inc. 3.55% 15/06/2025	29.885	0,50	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				4.914.003	81,54	
USD	80.000	Wells Fargo & Company 3.00% 23/10/2026	75.052	1,25	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt						
USD	52.000	Wells Fargo & Company FRN 22/05/2028	50.743	0,84	Anleihen						
USD	16.000	Williams Partners LP 5.10% 15/09/2045	16.300	0,27	KANADA						
USD	75.000	Xcel Energy Inc. 3.35% 01/12/2026	73.062	1,21	USD	35.000	Canadian National Railway 2.40% 03/02/2020	34.871	0,58		
Summe Vereinigte Staaten				3.273.404	54,31	USD	38.000	Toronto-Dominion Bank 2.55% 25/01/2021	37.526	0,62	
Summe Anleihen				3.617.987	60,03	Summe Kanada				72.397	1,20
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente						NIEDERLANDE					
VEREINIGTE STAATEN						USD	43.000	Mondelez International Holdings Netherlands BV 1.63% 28/10/2019	42.183	0,70	
USD	130.000	United States Treasury N/B 2.00% 31/01/2020	129.400	2,15	USD	5.000	Mylan NV 5.25% 15/06/2046	5.125	0,09		
USD	100.000	United States Treasury N/B 2.25% 29/02/2020	99.969	1,66	Summe Niederlande			47.308	0,79		
USD	100.000	United States Treasury N/B 2.25% 15/02/2021	99.641	1,65	VEREINIGTE STAATEN						
USD	50.000	United States Treasury N/B 2.50% 31/01/2025	49.445	0,82	USD	20.000	21 st Century Fox America Inc. 4.75% 15/09/2044	21.684	0,36		
USD	500.000	United States Treasury N/B 2.63% 28/02/2023	501.759	8,32	USD	21.000	AEP Texas Inc. 3.80% 01/10/2047	20.085	0,33		
USD	95.000	United States Treasury N/B 2.75% 15/02/2028	95.096	1,58	USD	26.000	Brighthouse Financial Inc. 4.70% 22/06/2047	23.985	0,40		
USD	225.000	United States Treasury N/B 2.75% 15/11/2047	214.980	3,57	USD	18.000	Broadcom Cayman Finance 3.50% 15/01/2028	16.961	0,28		
Summe Vereinigte Staaten				1.190.290	19,75	USD	45.000	Broadcom Cayman Finance 3.88% 15/01/2027	43.812	0,73	
Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				1.190.290	19,75	USD	45.000	Capital One 2.65% 08/08/2022	43.353	0,72	
					USD	15.000	Charter Communications Operating LLC 5.38% 01/05/2047	14.545	0,24		
					USD	18.000	Comcast Corp. 4.05% 01/11/2052	16.940	0,28		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt (Fortsetzung)				Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen					
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN					
USD	20.000	CSX Corp. 4.30% 01/03/2048	19.999	0,33	USD	12.000	AIG Global Funding 2.15% 02/07/2020	11.777	0,20
USD	54.000	Emera USA Finance LP 4.75% 15/06/2046	54.363	0,90	Summe Vereinigte Staaten				
USD	36.000	Enterprise Products Operating LLC 4.25% 15/02/2048	35.306	0,59	Summe Anleihen				
USD	10.000	ERP Operating 3.50% 01/03/2028	9.766	0,16	Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				
USD	9.000	Johnson & Johnson 1.95% 10/11/2020	8.850	0,15	Wert der Anlagen, insgesamt				
USD	19.000	Massachusetts Mutual Life Insurance 4.90% 01/04/2077	19.597	0,33	(Gesamtkosten: USD 5.893.823)				
USD	150.000	Metropolitan Life Global Funding 2.05% 12/06/2020	147.173	2,43	5.816.605				
USD	67.000	Morgan Stanley FRN 24/01/2029	66.065	1,10	96,53				
USD	7.000	Norfolk Southern Corp. 4.05% 15/08/2052	6.772	0,11					
USD	23.000	Northwestern Mutual 3.85% 30/09/2047	21.817	0,36					
USD	14.000	Teachers Insurance & Annuity Association America 4.90% 15/09/2044	15.381	0,26					
USD	28.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	28.078	0,47					
USD	70.000	The Guardian Life 4.88% 19/06/2064	73.817	1,23					
Summe Vereinigte Staaten			708.349	11,76					
Summe Anleihen			828.054	13,75					
Aktien									
VEREINIGTE STAATEN									
	60.000	Five Corners Funding P.P. 144A 15/11/2023	62.771	1,04					
Summe Vereinigte Staaten			62.771	1,04					
Summe Aktien			62.771	1,04					
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt			890.825	14,79					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)					
KAIMANINSELN				ISLE OF MAN					
USD	500.000	Alibaba Group Holding Limited 3.60% 28/11/2024	496.414	1,01	USD	500.000	Gohl Capital Limited 4.25% 24/01/2027	492.764	1,01
USD	400.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	380.272	0,78	Summe Isle of Man				
USD	500.000	Anton Oilfield Services Group 9.75% 05/12/2020	522.813	1,07	MALAYSIA				
USD	500.000	CDBL Funding 4.25% 02/12/2024	505.014	1,03	USD	500.000	Press Metal Labuan Limited 4.80% 30/10/2022	483.407	0,99
USD	350.000	FWD Group Limited FRN Perp.	254.333	0,52	Summe Malaysia				
USD	1.000.000	Longfor Properties Company 4.50% 16/01/2028	958.364	1,96	MAURITIUS				
USD	500.000	Times China Holdings 6.25% 17/01/2021	494.751	1,01	USD	500.000	UPL Corp. Limited 4.50% 08/03/2028	494.981	1,01
USD	857.000	VLL International Inc. 5.75% 28/11/2024	848.656	1,73	Summe Mauritius				
USD	250.000	Wynn Macau Limited 4.88% 01/10/2024	244.615	0,50	MONGOLEI				
USD	250.000	Wynn Macau Limited 5.50% 01/10/2027	245.730	0,50	USD	450.000	Trade & Development Bank of Mongolia LLC 9.38% 19/05/2020	484.386	0,99
Summe Kaimaninseln			4.950.962	10,11	Summe Mongolei				
					484.386 0,99				
CHINA				NIEDERLANDE					
USD	1.000.000	Bank of China Limited 5.00% 13/11/2024	1.031.212	2,10	USD	400.000	Indo Energy Finance II BV 6.38% 24/01/2023	399.200	0,81
Summe China			1.031.212	2,10	USD	500.000	Pb International BV 7.63% 26/01/2022	514.144	1,05
					Summe Niederlande				
HONGKONG				PHILIPPINEN					
USD	500.000	China National Chemical Corporation 4.63% 14/03/2023	503.305	1,02	USD	1.000.000	Rizal Commercial Banking 4.13% 16/03/2023	1.001.409	2,04
USD	500.000	Far East Horizon Limited 4.38% 27/02/2023	498.346	1,02	USD	723.000	Union Bank of the Philippines 3.37% 29/11/2022	706.092	1,44
Summe Hongkong			1.001.651	2,04	Summe Philippinen				
					1.707.501 3,48				
INDIEN				SÜDKOREA					
USD	500.000	Hindustan Petroleum Corp. Limited 4.00% 12/07/2027	479.059	0,98	USD	1.000.000	Daegu Bank 3.75% 13/08/2023	1.002.276	2,05
USD	500.000	NTPC Limited 4.50% 19/03/2028	499.119	1,02	USD	500.000	Hyundai Capital Services 3.75% 05/03/2023	496.272	1,01
USD	500.000	Rural Electrification Corp. 4.63% 22/03/2028	500.222	1,02	USD	1.000.000	Shinhan Bank 4.50% 26/03/2028	999.672	2,04
Summe Indien			1.478.400	3,02	USD	600.000	Woori Bank Company Limited 4.75% 30/04/2024	613.317	1,25
					Summe Südkorea				
					3.111.537 6,35				
INDONESIEN									
USD	500.000	ABM Investama Tbk 7.13% 01/08/2022	496.517	1,01					
Summe Indonesien			496.517	1,01					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens			
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)						
Anleihen (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)						
SINGAPUR				INDONESIEN (Fortsetzung)						
USD	600.000	Golden Legacy Pte Limited 6.88% 27/03/2024	591.000	1,21	IDR	6.500.000.000	Indonesia (Govt of) 6.13% 15/05/2028	452.510	0,92	
USD	500.000	Medco Straits Services Pte Limited 8.50% 17/08/2022	530.448	1,08	USD	200.000	Indonesia (Govt of) 6.63% 17/02/2037	242.478	0,49	
USD	1.000.000	Oversea-Chinese Banking Corp. Limited 4.25% 19/06/2024	1.015.835	2,07	IDR	6.313.000.000	Indonesia (Govt of) 7.00% 15/05/2027	465.718	0,95	
USD	500.000	ST Engineering 4.80% 16/07/2019	512.397	1,05	IDR	9.000.000.000	Indonesia (Govt of) 7.50% 15/08/2032	674.399	1,38	
USD	800.000	United Overseas Bank Limited FRN Perp.	767.084	1,57	USD	300.000	Indonesia (Govt of) 7.75% 17/01/2038	407.018	0,83	
		Summe Singapur	3.416.764	6,98	IDR	14.900.000.000	Indonesia (Govt of) 8.38% 15/03/2024	1.180.900	2,41	
					IDR	8.521.000.000	Indonesia (Govt of) 8.38% 15/09/2026	680.420	1,39	
THAILAND					USD	300.000	Perusahaan Penerbit Sbsn Indonesia 4.35% 10/09/2024	305.540	0,62	
USD	600.000	PTTEP Treasury Center FRN Perp.	590.855	1,20			Summe Indonesien	8.764.274	17,87	
		Summe Thailand	590.855	1,20	MONGOLEI					
VEREINIGTES KÖNIGREICH					USD	1.000.000	Mongolia (Govt of) 8.75% 09/03/2024	1.127.380	2,30	
USD	500.000	Vedanta Resources plc 6.13% 09/08/2024	489.688	1,00	USD	250.000	Mongolia (Govt of) 10.88% 06/04/2021	288.388	0,59	
		Summe Vereinigtes Königreich	489.688	1,00			Summe Mongolei	1.415.768	2,89	
BRITISCHE JUNGFERNINSELN					USD	1.200.000	Pakistan (Govt of) 6.88% 05/12/2027	1.136.586	2,32	
USD	439.000	Tianqi Finco Company 3.75% 28/11/2022	429.980	0,88			Summe Pakistan	1.136.586	2,32	
USD	500.000	Wharf Real Estate Investment 3.50% 17/01/2028	477.453	0,97	PHILIPPINEN					
		Summe Britische Jungferninseln	907.433	1,85	USD	500.000	Philippine (Govt of) 4.00% 15/01/2021	512.200	1,05	
Summe Anleihen				22.051.402	45,00	USD	200.000	Philippine (Govt of) 8.38% 17/06/2019	214.263	0,44
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente					USD	250.000	Philippines (Govt of) 9.88% 15/01/2019	264.793	0,54	
INDONESIEN					USD	200.000	Power Sector Assets & Liabilities Management Corp. 7.39% 02/12/2024	242.735	0,50	
USD	400.000	Indonesia (Govt of) 3.38% 15/04/2023	392.212	0,80			Summe Philippinen	1.233.991	2,53	
USD	500.000	Indonesia (Govt of) 3.70% 08/01/2022	501.968	1,02	SÜDKOREA					
USD	1.500.000	Indonesia (Govt of) 4.35% 11/01/2048	1.431.492	2,92	USD	1.000.000	Korea Housing Finance Corp 3.00% 31/10/2022	980.469	2,00	
USD	700.000	Indonesia (Govt of) 5.25% 17/01/2042	738.678	1,51	USD	500.000	Korea National Oil 3.25% 10/07/2024	487.020	0,99	
IDR	18.000.000.000	Indonesia (Govt of) 5.63% 15/05/2023	1.290.941	2,63			Summe Südkorea	1.467.489	2,99	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt					
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente					
SRI LANKA				MALAYSIA					
USD	500.000	Sri Lanka (Govt of) 6.25% 04/10/2020	519.694	1,06	MYR	3.000.000	Malaysia (Govt of) 3.23% 15/04/2020	770.570	1,57
USD	400.000	Sri Lanka (Govt of) 6.25% 27/07/2021	415.727	0,85	MYR	2.000.000	Malaysia (Govt of) 3.44% 15/02/2021	518.005	1,06
		Summe Sri Lanka	935.421	1,91	MYR	1.000.000	Malaysia (Govt of) 3.88% 14/03/2025	259.152	0,53
THAILAND					MYR	7.000.000	Malaysia (Govt of) 3.95% 14/04/2022	1.820.835	3,72
THB	17.000.000	Thailand (Govt of) 2.13% 17/12/2026	532.215	1,09	MYR	1.000.000	Malaysia (Govt of) 4.26% 26/07/2027	261.490	0,53
		Summe Thailand	532.215	1,09			Summe Malaysia	3.630.052	7,41
VIETNAM					Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
USD	500.000	Vietnam (Govt of) 4.80% 19/11/2024	512.189	1,05			3.630.052	7,41	
		Summe Vietnam	512.189	1,05	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt				
Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				15.997.933	32,65			3.630.052	7,41
Aktien					Wert der Anlagen, insgesamt				
CHINA								42.786.701	87,32
	400.000	Bluestar Finance Holdings Limited 11/06/2020	404.624	0,83	(Gesamtkosten: USD 42.887.778)				
		Summe China	404.624	0,83					
Summe Aktien				404.624	0,83				
Wandelanleihen									
HONGKONG									
USD	700.000	Dah Sing Bank Limited FRN 30/11/2026	702.690	1,43					
		Summe Hongkong	702.690	1,43					
Summe Wandelanleihen				702.690	1,43				
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				39.156.649	79,91				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
JERSEY - KANALINSELN				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
6.542	Ferguson plc	491.343	0,70	6.479	Gilead Sciences Inc.	488.452	0,70
	Summe Jersey - Kanalinseln	491.343	0,70	3.053	Goldman Sachs Group Inc.	768.929	1,09
MEXIKO				13.794	Halliburton Company	647.490	0,92
2.698	Fomento Economico Mexicano SAB de CV - ADR	246.678	0,35	2.589	Illumina Inc.	612.090	0,86
	Summe Mexiko	246.678	0,35	9.155	JPMorgan Chase & Company	1.006.774	1,44
NIEDERLANDE				1.265	Lam Research Corp.	256.998	0,37
25.683	RELX NV	531.596	0,76	8.014	Macom Technology Solutions	133.032	0,19
	Summe Niederlande	531.596	0,76	4.569	Mastercard Inc. - A	800.306	1,14
SPANIEN				9.620	Microsoft Corp.	878.017	1,25
6.071	Inditex SA	189.871	0,27	9.023	Nike Inc.	599.488	0,85
	Summe Spanien	189.871	0,27	3.164	Stryker Corp.	509.151	0,72
SCHWEIZ				2.716	Tesaro Inc.	155.192	0,22
5.865	Tyco Electronics Limited	585.913	0,83	1.172	Tyler Technologies Inc.	247.245	0,35
26.113	UBS Group AG	457.986	0,65	4.392	Union Pacific Corp.	590.417	0,84
	Summe Schweiz	1.043.899	1,48	1.565	United Rentals Inc.	270.322	0,38
VEREINIGTES KÖNIGREICH				3.365	Vertex Pharmaceuticals Inc.	548.428	0,78
3.578	Aon plc	502.101	0,71	6.385	Visa Inc. - A	763.774	1,09
11.405	Diageo plc	385.894	0,55		Summe Vereinigte Staaten	19.609.743	27,93
11.496	Rio Tinto plc	582.331	0,83		Summe Aktien	34.416.107	48,99
14.475	Unilever plc	803.185	1,14		Strukturierte Instrumente - Rohstoffe		
	Summe Vereinigtes Königreich	2.273.511	3,23		IRLAND		
VEREINIGTE STAATEN				1.691	Source Physical Gold ETC 0.00%	217.936	0,31
5.862	Activision Blizzard Inc.	395.451	0,56		Summe Irland	217.936	0,31
1.169	Alphabet Inc. - A	1.212.416	1,73		Summe Strukturierte Instrumente - Rohstoffe	217.936	0,31
259	Alphabet Inc. - C	267.234	0,38		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	49.374.979	70,28
717	Amazon.com Inc.	1.037.742	1,49		Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren		
3.900	Amphenol Corp.	335.907	0,48		Fonds		
27.810	Bank of America Corp.	834.022	1,20		LUXEMBURG		
8.471	BB&T Corp.	440.831	0,63	384.726	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio - XU	5.947.862	8,46
3.055	Celgene Corp.	272.537	0,39		Summe Luxemburg	5.947.862	8,46
6.573	Centene Corp.	702.457	1,00		VEREINIGTES KÖNIGREICH		
14.761	Charles Schwab Corp.	770.820	1,09	268.945	Threadneedle Investment Funds ICVC - European High Yield Bond Fund - X	510.455	0,73
9.539	Comcast Corp.	325.948	0,46		Summe Vereinigtes Königreich	510.455	0,73
1.557	Cooper Companies Inc.	356.257	0,51		Summe Fonds	6.458.317	9,19
6.522	Dentsply Sirona Inc.	328.122	0,47		Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	6.458.317	9,19
5.820	Diamondback Energy Inc.	736.346	1,05		Wert der Anlagen, insgesamt	55.833.296	79,47
2.033	Ecolab Inc.	278.663	0,40		(Gesamtkosten: USD 50.362.702)		
5.497	Eog Resources Inc.	578.670	0,82				
672	Equinix Inc.	280.990	0,40				
3.906	Estee Lauder Companies Inc.	584.806	0,83				
3.720	Facebook Inc. - A	594.419	0,85				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Aufstellung der Wertpapiieranlage

zum 31. März 2018

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens				
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)							
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)							
AUSTRALIEN				FRANKREICH (Fortsetzung)							
EUR	380.000	Origin Energy Finance Limited FRN 16/09/2074	487.405	0,16	EUR	100.000	Crown European Holdings 2.63% 30/09/2024	123.655	0,04		
EUR	200.000	Origin Energy Finance Limited FRN 16/06/2071	249.694	0,08	EUR	100.000	Crown European Holdings 3.38% 15/05/2025	127.370	0,04		
		Summe Australien	737.099	0,24	EUR	325.000	Crown European Holdings 4.00% 15/07/2022	435.057	0,15		
ÖSTERREICH				EUR				100.000	Crown European Holdings SA 2.25% 01/02/2023	124.006	0,04
EUR	100.000	Bawag PSK 8.13% 30/10/2023	165.730	0,06	EUR	175.000	Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026	213.889	0,07		
EUR	300.000	Steinhoff Europe AG 1.88% 24/01/2025	214.935	0,07	EUR	200.000	Elis SA 1.88% 15/02/2023	245.331	0,08		
		Summe Österreich	380.665	0,13	EUR	200.000	Elis SA 2.88% 15/02/2026	245.418	0,08		
BELGIEN				EUR				464.000	Elis SA 3.00% 30/04/2022	580.429	0,20
EUR	200.000	KBC Groep NV FRN Perp.	255.081	0,09	EUR	112.000	Holdikks SAS 6.75% 15/07/2021	91.083	0,03		
		Summe Belgien	255.081	0,09	EUR	200.000	Horizon Holdings III 5.13% 01/08/2022	255.303	0,09		
KANADA				EUR				400.000	Horizon Holdings SAS 7.25% 01/08/2023	517.980	0,17
EUR	560.000	Cott Finance Corp. 5.50% 01/07/2024	734.415	0,24	EUR	240.000	La Financiere Atalian SAS 4.00% 15/05/2024	301.493	0,10		
EUR	405.000	Valeant Pharmaceuticals International Inc. 4.50% 15/05/2023	441.899	0,15	EUR	100.000	New Areva Holding SA 3.25% 04/09/2020	128.932	0,04		
		Summe Kanada	1.176.314	0,39	EUR	200.000	New Areva Holding SA 3.50% 22/03/2021	260.626	0,09		
KAIMANINSELN				EUR				246.000	Orange SA FRN Perp.	346.545	0,12
GBP	415.000	Petrobras International Finance Company 6.25% 14/12/2026	623.745	0,21	EUR	245.000	Paprec Holding 5.25% 01/04/2022	309.671	0,10		
EUR	110.000	UPCB Finance VII 3.63% 15/06/2029	131.826	0,04	EUR	100.000	Paprec Holding SA 3.16% 31/03/2025	123.727	0,04		
		Summe Kaimaninseln	755.571	0,25	EUR	355.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	440.273	0,15		
FINNLAND				EUR				100.000	Paprec Holding SA 7.38% 01/04/2023	129.957	0,04
EUR	100.000	Stora Enso Oyj 2.50% 07/06/2027	124.669	0,04	EUR	160.000	Rexel SA 2.13% 15/06/2025	191.630	0,06		
		Summe Finnland	124.669	0,04	EUR	200.000	Rexel SA 3.50% 15/06/2023	256.985	0,09		
FRANKREICH				EUR				200.000	SASU Newco SAB 20 SAS 4.25% 30/09/2024	239.390	0,08
EUR	200.000	Accor SA FRN Perp.	261.200	0,09	EUR	425.000	SFR Group SA 5.38% 15/05/2022	533.758	0,18		
EUR	500.000	Casino Guichard-Perrachon SA 4.50% 07/03/2024	652.581	0,22	EUR	300.000	SFR Group SA 5.63% 15/05/2024	375.244	0,13		
EUR	200.000	CMA CGM SA 5.25% 15/01/2025	221.732	0,07	EUR	605.000	Solvay Finance SA FRN Perp.	828.158	0,27		
EUR	100.000	Constantin Investissement 3 SASU 5.38% 15/04/2025	121.597	0,04	EUR	300.000	SPCM SA 2.88% 15/06/2023	375.702	0,13		
EUR	250.000	Credit Agricole SA FRN Perp.	345.394	0,12	EUR	300.000	Spie SA 3.13% 22/03/2024	372.937	0,13		
					EUR	410.000	Synlab Bondco plc 6.25% 01/07/2022	525.826	0,18		
					EUR	200.000	Vallourec SA 2.25% 30/09/2024	207.610	0,07		
					EUR	100.000	Vallourec SA 6.63% 15/10/2022	128.448	0,04		
					GBP	100.000	Veolia Environnement SA FRN Perp.	140.501	0,05		
							Summe Frankreich	10.779.438	3,62		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
DEUTSCHLAND				IRLAND (Fortsetzung)					
EUR	175.000	Adler Real Estate AG 1.50% 06/12/2021	215.473	0,07	EUR	250.000	Smurfit Kappa Acquisitions 2.38% 01/02/2024	320.026	0,11
EUR	210.000	Adler Real Estate AG 2.13% 06/02/2024	256.842	0,09	GBP	1.025.000	Virgin Media Receivables Financing Note 5.50% 15/09/2024	1.415.922	0,47
EUR	200.000	Demire Deutsche Mittelstand Real Estate AG 2.88% 15/07/2022	251.711	0,08	Summe Irland				
EUR	109.000	IHO Verwaltungs GmbH 2.75% 15/09/2021	136.724	0,05	4.160.203				
EUR	350.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.25% 15/09/2023	443.627	0,15	1,40				
EUR	310.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.75% 15/09/2026	398.340	0,13	ITALIEN				
EUR	272.000	Lanxess AG FRN 06/12/2076	366.605	0,12	EUR	302.000	Banco BPM SpA 2.75% 27/07/2020	387.388	0,13
EUR	100.000	Platin 1426 GmbH 5.38% 15/06/2023	121.921	0,04	EUR	260.000	CMF SpA 9.00% 15/06/2022	292.533	0,10
EUR	160.000	Progroup AG 3.00% 31/03/2026	195.716	0,07	EUR	378.000	Enel SpA FRN 15/01/2075	500.083	0,17
EUR	200.000	Progroup AG 5.13% 01/05/2022	253.563	0,09	EUR	150.000	Enel SpA FRN 10/01/2074	193.293	0,06
GBP	400.000	RWE AG FRN Perp.	582.737	0,21	EUR	216.000	Leonardo SpA 1.50% 07/06/2024	258.492	0,09
EUR	185.000	Safari Holding 5.38% 30/11/2022	230.179	0,08	EUR	325.000	Lkq Italia Bondco 3.88% 01/04/2024	422.236	0,14
EUR	365.000	Thyssenkrupp AG 2.75% 08/03/2021	473.409	0,16	EUR	325.000	Telecom Italia SpA 3.00% 30/09/2025	421.688	0,14
EUR	225.000	Unitymedia Hessen GmbH & Company 3.50% 15/01/2027	290.898	0,10	EUR	100.000	Telecom Italia SpA 3.63% 19/01/2024	135.425	0,05
EUR	375.000	Unitymedia Hessen GmbH & Company 4.00% 15/01/2025	486.998	0,16	EUR	450.000	Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	605.770	0,20
EUR	435.000	Unitymedia Hessen GmbH & Company 6.25% 15/01/2029	604.703	0,20	EUR	325.000	Telecom Italia SpA 4.50% 25/01/2021	443.934	0,15
EUR	300.000	Unitymedia Kabelbw GmbH 3.75% 15/01/2027	388.088	0,13	EUR	500.000	Telecom Italia SpA 5.25% 10/02/2022	715.532	0,24
EUR	240.000	Wepa Hygieneprodukte GmbH 3.75% 15/05/2024	300.276	0,10	EUR	100.000	Telecom Italia SpA 5.25% 17/03/2055	141.334	0,05
Summe Deutschland				5.997.810	2,03	Summe Italien			
						5.185.896			
						1,74			
IRLAND				JAPAN					
EUR	200.000	Allied Irish Banks FRN 26/11/2025	263.888	0,09	EUR	333.000	Softbank Group Corp. 3.13% 19/09/2025	385.253	0,13
GBP	200.000	Ardagh Group 4.75% 15/07/2027	273.905	0,09	EUR	275.000	Softbank Group Corp. 4.00% 30/07/2022	359.842	0,12
EUR	400.000	Ardagh Packaging Finance 2.75% 15/03/2024	498.660	0,18	EUR	130.000	Softbank Group Corp. 4.00% 19/09/2029	144.043	0,05
EUR	300.000	Ardagh Packaging Finance 6.75% 15/05/2024	401.051	0,13	EUR	415.000	Softbank Group Corp. 4.75% 30/07/2025	534.199	0,18
EUR	200.000	Bank of Ireland FRN Perp.	273.642	0,09	EUR	100.000	Softbank Group Corp. 5.25% 30/07/2027	130.324	0,04
EUR	375.000	Eircom Fianance 4.50% 31/05/2022	473.066	0,16	Summe Japan				
EUR	195.000	Europcar Drive Designated Activity 4.13% 15/11/2024	240.043	0,08	1.553.661				
						0,52			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)			
JERSEY - KANALINSELN				LUXEMBURG (Fortsetzung)			
GBP	100.000 CpuK Finance Limited 4.25% 28/08/2022	141.528	0,05	EUR	225.000 Fiat Finance & Trade 6.75% 14/10/2019	304.004	0,10
GBP	100.000 CpuK Finance Limited 4.88% 28/08/2025	141.408	0,05	EUR	562.000 Garfunkelux Holdco 3 SA 7.50% 01/08/2022	705.518	0,24
EUR	510.000 Lhc3 plc 4.13% 15/08/2024	631.978	0,21	GBP	200.000 Garfunkelux Holdco 3 SA 8.50% 01/11/2022	284.948	0,10
EUR	300.000 Lincoln Finance Limited 6.88% 15/04/2021	382.074	0,13	EUR	200.000 Gazprom OAO 4.63% 15/10/2018	251.485	0,08
EUR	325.000 Mercury Bondco 7.13% 30/05/2021	413.691	0,14	USD	450.000 Gazprom OAO via Gaz Capital SA 6.00% 23/01/2021	473.408	0,16
EUR	495.000 Mercury Bondco 8.25% 30/05/2021	636.309	0,21	EUR	230.000 Gestamp Fund Lux 3.50% 15/05/2023	293.906	0,09
GBP	220.000 Tvl Finance plc 8.50% 15/05/2023	332.093	0,11	EUR	400.000 Grand City Properties SA FRN Perp.	522.606	0,18
	Summe Jersey - Kanalinseln	2.679.081	0,90	EUR	400.000 Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	519.008	0,17
				EUR	215.000 Horizon Parent Holdings Sarl 8.25% 15/02/2022	280.202	0,09
LUXEMBURG				EUR	173.000 Ineos Group Holdings SA 5.38% 01/08/2024	224.983	0,08
EUR	125.000 Altice Financing SA 5.25% 15/02/2023	159.077	0,05	EUR	200.000 Intralot Capital Lux 5.25% 15/09/2024	247.079	0,08
EUR	225.000 Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	243.591	0,08	EUR	200.000 Intralot Capital Lux 6.75% 15/09/2021	260.326	0,09
EUR	500.000 Altice SA 6.25% 15/02/2025	571.262	0,19	EUR	125.000 Lecta SA 6.50% 01/08/2023	159.041	0,05
EUR	575.000 Altice SA 7.25% 15/05/2022	690.250	0,23	EUR	293.000 Matterhorn Telecom 4.88% 01/05/2023	361.360	0,12
GBP	100.000 Amigo Luxembourg SA 7.63% 15/01/2024	144.293	0,05	EUR	250.000 Matterhorn Telecom SA 3.88% 01/05/2022	310.749	0,10
EUR	240.000 Aramark International Finance 3.13% 01/04/2025	307.398	0,10	EUR	100.000 Matterhorn Telecom SA 4.00% 15/11/2027	118.737	0,04
EUR	232.000 ARD Finance SA 6.63% 15/09/2023	301.524	0,10	EUR	149.000 Sberbank 3.35% 15/11/2019	191.001	0,06
EUR	100.000 Arena Luxembourg Finance SarL FRN 01/11/2023	124.194	0,04	EUR	125.000 Takko Luxembourg 2 SCA 5.38% 15/11/2023	149.834	0,05
EUR	100.000 Arena Luxembourg Finance SarL 2.88% 01/11/2024	125.783	0,04	EUR	169.000 Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	310.291	0,10
EUR	200.000 Braas Monier Building Group SCA 3.00% 15/06/2021	250.314	0,08	EUR	100.000 Wolverine Investments 4.63% 15/03/2024	123.754	0,04
EUR	100.000 Cirsa Funding Luxembourg SA 5.75% 15/05/2021	126.988	0,04	EUR	300.000 Wolverine Investments 5.00% 15/03/2024	373.475	0,14
EUR	200.000 Cirsa Funding Luxembourg SA 5.88% 15/05/2023	253.144	0,08		Summe Luxemburg	12.035.375	4,00
EUR	235.000 CNH Industrial NV 2.88% 27/09/2021	312.935	0,10				
EUR	325.000 Codere Finance 2 Luxembourg SA 6.75% 01/11/2021	419.470	0,14	MEXIKO			
EUR	300.000 Crystal Almond SarL 10.00% 01/11/2021	402.477	0,13	EUR	200.000 Cemex SAB de CV 2.75% 05/12/2024	244.554	0,08
EUR	400.000 Dufry Finance SCA 4.50% 01/08/2023	514.270	0,18	EUR	155.000 Cemex SAB de CV 4.38% 05/03/2023	199.653	0,07
EUR	325.000 Fiat Finance & Trade 4.75% 22/03/2021	442.534	0,15		Summe Mexiko	444.207	0,15
EUR	130.000 Fiat Finance & Trade 4.75% 15/07/2022	180.156	0,06				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
NIEDERLANDE				NIEDERLANDE (Fortsetzung)					
EUR	100.000	Constellium NV 4.25% 15/02/2026	124.875	0,04	GBP	500.000	Telefonica Europe BV FRN Perp.	767.252	0,27
EUR	310.000	Dufry One BV 2.50% 15/10/2024	385.154	0,13	EUR	465.000	TenneT Holding BV FRN Perp.	584.805	0,20
EUR	250.000	Fiat Chrysler Automobiles NV 3.75% 29/03/2024	335.665	0,11	EUR	234.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.13% 15/10/2024	240.197	0,08
EUR	100.000	Hertz Holdings Netherlands BV 4.38% 15/01/2019	127.334	0,04	EUR	309.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.25% 31/03/2023	344.872	0,12
EUR	155.000	Hertz Holdings Netherlands BV 5.50% 30/03/2023	190.686	0,06	EUR	160.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.25% 15/04/2022	197.753	0,07
GBP	200.000	Intergen NV 7.50% 30/06/2021	281.612	0,09	EUR	240.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	296.136	0,10
EUR	600.000	Interxion Holding 6.00% 15/07/2020	761.917	0,26	EUR	275.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	344.207	0,12
EUR	200.000	IpD 3 BV 4.50% 15/07/2022	251.266	0,08	EUR	300.000	UPC Holding BV 3.88% 15/06/2029	346.055	0,12
EUR	150.000	Koninklijke Kpn NV FRN Perp.	189.265	0,06	EUR	300.000	Ziggo Bond Finance BV FRN 15/01/2025	371.941	0,12
GBP	240.000	Koninklijke KPN NV FRN 14/03/2073	364.598	0,12	EUR	329.000	Ziggo Company BV 7.13% 15/05/2024	437.367	0,15
EUR	316.000	LKQ Euro Holdings 3.63% 01/04/2026	391.089	0,13	EUR	335.000	Ziggo Secured Finance BV 4.25% 15/01/2027	416.792	0,14
EUR	220.000	Maxeda DIY Holding BV 6.13% 15/07/2022	260.015	0,09			Summe Niederlande	13.219.513	4,45
EUR	100.000	Nyrstar Netherlands 6.88% 15/03/2024	126.053	0,04			PORTUGAL		
EUR	150.000	Oi European Group BV 6.75% 15/09/2020	211.037	0,07	EUR	200.000	Energias de Portugal FRN 16/09/2075	273.425	0,09
EUR	100.000	OI European Group BV 3.13% 15/11/2024	125.182	0,04			Summe Portugal	273.425	0,09
EUR	550.000	Petrobras Global Finance BV 3.75% 14/01/2021	726.723	0,25			RUSSISCHE FÖDERATION		
EUR	200.000	Petrobras Global Finance BV 4.75% 14/01/2025	267.387	0,09	GBP	673.000	Gazprom OAO 4.25% 06/04/2024	981.983	0,33
GBP	175.000	Petrobras Global Finance BV 5.38% 01/10/2029	242.789	0,08	EUR	233.000	Gazprom OAO via Gaz Capital SA 3.13% 17/11/2023	301.443	0,10
EUR	100.000	Repsol International Finance BV FRN Perp.	131.963	0,04			Summe Russische Föderation	1.283.426	0,43
EUR	374.000	Repsol International Finance BV FRN 25/03/2075	503.683	0,17			SPANIEN		
EUR	175.000	Schaeffler Finance BV 3.50% 15/05/2022	217.996	0,07	EUR	100.000	Bankia SA FRN 15/03/2027	130.765	0,04
EUR	1.100.000	Telefonica Europe FRN Perp.	1.410.139	0,48	EUR	200.000	Cellnex Telecom SA 2.38% 16/01/2024	250.596	0,08
EUR	300.000	Telefonica Europe BV 3.00% Perp.	365.286	0,12	EUR	300.000	Cellnex Telecom SA 2.88% 18/04/2025	380.368	0,12
EUR	400.000	Telefonica Europe BV 3.88% Perp.	486.637	0,17	EUR	407.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	506.077	0,17
EUR	100.000	Telefonica Europe BV FRN Perp.	129.465	0,04			Summe Spanien	1.267.806	0,41
EUR	200.000	Telefonica Europe BV FRN Perp.	264.320	0,09					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens				
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)							
Anleihen (Fortsetzung)				Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen (Fortsetzung)							
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)				VEREINIGTES KÖNIGREICH							
GBP	100.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.13% 15/01/2025	143.761	0,05	GBP	157.500	Virgin Media Secured Finance plc 5.50% 15/01/2025	227.074	0,08		
GBP	100.000	Viridian Group 4.75% 15/09/2024	132.129	0,04			Summe Vereinigtes Königreich	227.074	0,08		
GBP	250.000	Voyage Care 5.88% 01/05/2023	353.769	0,12			Summe Forderungs- und hypothekenbesicherte Wertpapiere	609.956	0,20		
GBP	200.000	William Hill plc 4.88% 07/09/2023	297.236	0,10			Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
		Summe Vereinigtes Königreich	15.464.663	5,19			MEXIKO				
VEREINIGTE STAATEN							MXN	850.625	Mexico (Govt of) Bonos 7.50% 03/06/2027	4.717.002	1,58
EUR	485.000	Avantor Inc. 4.75% 01/10/2024	595.029	0,20	MXN	871.000	Mexico (Govt of) Bonos 10.00% 05/12/2024	5.467.842	1,84		
EUR	390.000	Axalta Coating System Limited 4.25% 15/08/2024	507.968	0,17			Summe Mexiko	10.184.844	3,42		
EUR	325.000	Ball Corp. 4.38% 15/12/2023	453.374	0,15			Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente	10.184.844	3,42		
EUR	420.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 4.75% 15/12/2024	542.365	0,17			Aktien				
EUR	438.000	Cemex Finance LLC 4.63% 15/06/2024	576.203	0,20			AUSTRALIEN				
EUR	335.000	Colfax Corp. 3.25% 15/05/2025	416.562	0,14			116.400	Amcor Limited	1.265.163	0,42	
EUR	593.000	Equinix Inc. 2.88% 01/10/2025	703.318	0,24			300.716	Dulux Group Limited	1.702.302	0,57	
EUR	600.000	Equinix Inc. 2.88% 01/02/2026	705.196	0,24			277.772	Goodman Group	1.796.138	0,60	
USD	40.000	Equinix Inc. 5.38% 15/05/2027	40.676	0,01			314.234	Sydney Airport Finance Company Pty Limited	1.617.333	0,54	
EUR	100.000	Iron Mountain Inc. 3.00% 15/01/2025	122.222	0,04			184.084	Transurban Group	1.612.523	0,54	
EUR	352.000	Kronos International 3.75% 15/09/2025	445.232	0,16			Summe Australien	7.993.459	2,67		
EUR	480.000	Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	582.718	0,20			ÖSTERREICH				
EUR	997.000	Quintiles IMS Inc. 3.25% 15/03/2025	1.231.536	0,40			39.999	Erste Group Bank AG	2.007.065	0,67	
EUR	304.000	Quintiles IMS Inc. 3.50% 15/10/2024	385.103	0,13			Summe Österreich	2.007.065	0,67		
EUR	350.000	Sealed Air Corp. 4.50% 15/09/2023	484.636	0,16			BRASILIEN				
EUR	599.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	751.126	0,26			321.772	Ambev SA	2.330.324	0,78	
EUR	332.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	428.585	0,14			229.877	Cielo SA	1.431.027	0,48	
GBP	598.000	Vantiv LLC 3.88% 15/11/2025	829.913	0,28			320.639	Kroton Educacional SA	1.312.040	0,44	
		Summe Vereinigte Staaten	9.801.762	3,29			Summe Brasilien	5.073.391	1,70		
Summe Anleihen		90.571.914	30,37				KANADA				
Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen							195.392	Manulife Financial Corp.	3.625.191	1,21	
LUXEMBURG							62.390	Suncor Energy Inc.	2.152.982	0,72	
EUR	287.100	TelenetFinVILux 4.88% 15/07/2027	382.882	0,12			45.396	Transcanada Corp.	1.876.052	0,63	
		Summe Luxemburg	382.882	0,12			Summe Kanada	7.654.225	2,56		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
KAIMANINSELN				JAPAN			
395.000	Anta Sports Products Limited	1.993.041	0,67	57.000	Bridgestone Corp.	2.480.450	0,83
1.993.000	HKT Trust and Hkt Limited	2.506.389	0,84	578.000	Daiwa Securities Group Inc. - ADR	3.675.611	1,24
	Summe Kaimaninseln	4.499.430	1,51	1.564	Japan Hotel REIT Investment	1.105.903	0,37
				8.600	Tokyo Electron Limited	1.553.821	0,52
					Summe Japan	8.815.785	2,96
DÄNEMARK				LUXEMBURG			
20.281	Coloplast A/S	1.708.571	0,57	405.000	Aguila 3 SA 15/12/2021	512.927	0,17
	Summe Dänemark	1.708.571	0,57	400.000	Leonardo SpA 19/01/2021	544.294	0,18
FINNLAND				Summe Luxemburg			
40.548	Sampo Oyj - A	2.257.024	0,76			1.057.221	0,35
	Summe Finnland	2.257.024	0,76	MEXIKO			
FRANKREICH				323.085	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	818.797	0,27
40.070	BNP Paribas	2.965.183	0,99		Summe Mexiko	818.797	0,27
	Summe Frankreich	2.965.183	0,99	NIEDERLANDE			
DEUTSCHLAND				14.400	Lyondellbasell Industries NV - A	1.521.792	0,51
27.746	Axel Springer AG	2.320.392	0,78	61.087	RELX NV	1.264.402	0,42
269.286	Deutsche Telekom AG - Reg	4.388.153	1,47	78.632	Unilever NV	4.435.884	1,49
13.225	Drillisch AG	890.496	0,30		Summe Niederlande	7.222.078	2,42
48.163	Evonik Industries AG	1.696.441	0,57	SÜDAFRIKA			
	Summe Deutschland	9.295.482	3,12	55.212	Spar Group Limited	943.874	0,32
HONGKONG					Summe Südafrika	943.874	0,32
153.500	Boc Hong Kong Holdings Limited	747.129	0,25	SPANIEN			
	Summe Hongkong	747.129	0,25	115.293	Ferrovial SA	2.405.519	0,81
INDONESIEN					Summe Spanien	2.405.519	0,81
8.535.900	Telekomunikasi Indonesia Tbk Pt	2.231.865	0,75	SCHWEIZ			
	Summe Indonesien	2.231.865	0,75	37.907	Novartis AG - Reg	3.058.369	1,03
ISLE OF MAN				152.180	UBS Group AG	2.669.029	0,89
142.537	Gvc Holdings plc	1.837.549	0,62		Summe Schweiz	5.727.398	1,92
	Summe Isle of Man	1.837.549	0,62	TAIWAN			
				57.000	Eclat Textile Company Limited	664.676	0,22
				448.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	3.749.074	1,25
					Summe Taiwan	4.413.750	1,47

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)				
THAILAND				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				
530.700	Siam Commercial Bank pcl - Reg	2.435.451	0,82	18.496	Valero Energy Corp.	1.715.874	0,58	
1.526.600	Thai Beverage pcl	908.067	0,30	13.747	Watsco Inc.	2.487.795	0,83	
	Summe Thailand	3.343.518	1,12	86.222	Wells Fargo & Company	4.518.895	1,52	
				Summe Vereinigte Staaten				
				Summe Aktien				
				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				
				266.762.763				
				89,45				
				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt				
				266.762.763				
				89,45				
VEREINIGTES KÖNIGREICH				Anleihen				
69.521	Anglo American plc	1.619.875	0,54	KANADA				
168.139	BAE Systems plc	1.371.321	0,46	USD	114.000	Valeant Pharmaceuticals 6.50% 15/03/2022	117.776	0,04
83.091	British American Tobacco plc	4.815.096	1,62	USD	247.000	Valeant Pharmaceuticals 7.00% 15/03/2024	257.806	0,09
578.716	BT Group plc	1.846.897	0,62	Summe Kanada				
121.083	Glaxosmithkline plc	2.367.782	0,79	375.582				
88.476	HSBC Holdings plc	825.855	0,28	0,13				
366.892	Legal & General Group plc	1.326.835	0,44	PORTUGAL				
369.658	Moneysupermarket.Com Group plc	1.487.219	0,50	EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2019	36.896	0,01
50.576	Rio Tinto plc	2.561.932	0,86	Summe Portugal				
100.000	Royal Bank of Scotland 15/12/2022	106.264	0,04	36.896				
125.319	Royal Dutch Shell plc - A	3.926.437	1,32	0,01				
83.489	St James's Place plc	1.272.491	0,43	VEREINIGTE STAATEN				
	Summe Vereinigtes Königreich	23.528.004	7,90	USD	100.000	Cott Holdings Inc. 5.50% 01/04/2025	98.944	0,03
				USD	200.000	CSC Holdings LLC P.P. 144A 10.88% 15/10/2025	235.181	0,08
				USD	120.000	Hertz Corp. 7.63% 01/06/2022	122.046	0,04
				Summe Vereinigte Staaten				
				456.171				
				0,15				
				Summe Anleihen				
				868.649				
				0,29				
				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt				
				868.649				
				0,29				
VEREINIGTE STAATEN								
40.749	Altria Group Inc.	2.539.478	0,85					
26.292	Apollo Global Management LLC - A	778.769	0,26					
118.277	Ares Capital Corp.	1.877.056	0,63					
39.957	Blackstone Group LP	1.276.626	0,43					
126.371	Cisco Systems Inc.	5.420.053	1,82					
14.463	CME Group Inc.	2.339.246	0,78					
73.043	Coca Cola Company	3.172.257	1,07					
106.573	Enterprise Products Partners LP	2.608.907	0,87					
60.074	General Motors Company	2.183.089	0,73					
58.723	L Brands Inc.	2.243.806	0,75					
17.913	Las Vegas Sands Corp.	1.287.945	0,43					
27.566	Maxim Integrated Products Inc.	1.660.025	0,56					
44.913	Merck & Company Inc.	2.446.411	0,82					
43.453	Nutrien Limited	2.053.588	0,69					
31.857	Occidental Petroleum Corp.	2.069.431	0,69					
55.996	Pacwest Bancorp	2.773.482	0,93					
42.932	Paychex Inc.	2.644.182	0,89					
128.860	Pfizer Inc.	4.573.241	1,54					
16.940	Philip Morris International Inc.	1.683.836	0,56					
24.596	Qualcomm Inc.	1.362.864	0,46					
71.939	Starwood Property Trust Inc.	1.507.122	0,51					
30.902	Tapestry Inc.	1.625.754	0,55					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Fonds			
LUXEMBURG			
1.169.973	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds - AUP	7.288.931	2,44
1.508.943	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond Portfolio - XUP	15.345.953	5,15
	Summe Luxemburg	22.634.884	7,59
	Summe Fonds	22.634.884	7,59
	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	22.634.884	7,59
	Wert der Anlagen, insgesamt	290.266.296	97,33
(Gesamtkosten: USD 283.890.827)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BELGIEN				SINGAPUR			
65.899	Anheuser-Busch InBev SA/NV	7.235.777	1,61	35.711	Broadcom Limited	8.415.297	1,87
	Summe Belgien	7.235.777	1,61		Summe Singapur	8.415.297	1,87
KAIMANINSELN				SPANIEN			
28.038	Alibaba Group Holding Limited	5.146.095	1,14	175.916	Cellnex Telecom SAU	4.692.638	1,04
136.496	Pagseguro Digital Limited	5.230.527	1,16		Summe Spanien	4.692.638	1,04
73.500	Tencent Holdings Limited	3.835.935	0,85				
	Summe Kaimaninseln	14.212.557	3,15	SCHWEDEN			
FRANKREICH				139.484	Atlas Companypc AB - B	5.404.621	1,20
469.106	Elis SA	11.596.293	2,58		Summe Schweden	5.404.621	1,20
	Summe Frankreich	11.596.293	2,58	VEREINIGTES KÖNIGREICH			
DEUTSCHLAND				91.404	Aon plc	12.826.723	2,85
59.075	Adidas AG	14.287.289	3,18	377.023	British American Tobacco plc	21.848.358	4,86
	Summe Deutschland	14.287.289	3,18	45.047	Genus plc	1.472.372	0,33
HONGKONG				73.414	Intercontinental Hotels Group plc	4.395.407	0,98
2.795.800	Aia Group Limited	23.653.649	5,27		Summe Vereinigtes Königreich	40.542.860	9,02
	Summe Hongkong	23.653.649	5,27	VEREINIGTE STAATEN			
INDIEN				129.158	Activision Blizzard Inc.	8.712.999	1,94
615.391	HDFC Bank Limited	18.162.712	4,04	61.356	Adobe Systems Inc.	13.257.804	2,95
869.551	Kotak Mahindra Bank Limited	13.969.223	3,11	20.821	Alphabet Inc. - A	21.594.292	4,81
	Summe Indien	32.131.935	7,15	9.264	Amazon.com Inc.	13.408.157	2,99
INDONESIEN				98.351	Applied Materials Inc.	5.469.299	1,22
1.381.700	Bank Central Asia Tbk Pt	2.338.222	0,52	527.490	Boston Scientific Corp.	14.411.027	3,20
	Summe Indonesien	2.338.222	0,52	94.692	Centene Corp.	10.119.734	2,25
IRLAND				124.411	Charles Schwab Corp.	6.496.742	1,45
222.581	Ryanair Holdings plc	4.379.860	0,97	15.058	Charter Communications Inc. - A	4.686.351	1,04
	Summe Irland	4.379.860	0,97	40.035	Cooper Companies Inc.	9.160.408	2,04
JAPAN				19.643	Equinix Inc.	8.213.524	1,83
32.956	Keyence Corp.	20.297.290	4,52	56.270	Estee Lauder Companies Inc.	8.424.744	1,87
190.400	Nihon M&A Center Inc.	6.507.792	1,45	96.111	IntercontinentalExchange Inc.	6.969.970	1,55
	Summe Japan	26.805.082	5,97	137.246	Mastercard Inc. - A	24.040.009	5,35
NIEDERLANDE				303.173	Microsoft Corp.	27.670.600	6,15
906.931	RELX NV	18.771.998	4,18	9.836	Nvidia Corp.	2.277.919	0,51
219.761	Unilever NV	12.397.426	2,76	39.800	PepsiCo Inc.	4.344.170	0,97
	Summe Niederlande	31.169.424	6,94	58.425	Thermo Fisher Scientific Inc.	12.062.426	2,68
SÜDKOREA				53.135	UnitedHealth Group Inc.	11.370.890	2,53
4.176	Samsung Electronics Company Limited	9.606.441	2,13		Summe Vereinigte Staaten	212.691.065	47,33
	Summe Südkorea	9.606.441	2,13		Summe Aktien	449.163.010	99,93
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind						449.163.010	99,93
Wert der Anlagen, insgesamt						449.163.010	99,93
(Gesamtkosten: USD 393.790.550)							

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
ARGENTINIEN				CHILE			
113	Banco Macro Bansud SA - ADR	12.201	0,26	577	Banco Santander Chile SA - ADR	19.335	0,42
1.315	Loma Negra Compania Industrial Argentina	28.036	0,61	322	Compania Cervecerias Unidas SA - ADR	9.470	0,21
1.833	YPF SA - ADR	39.629	0,86				
	Summe Argentinien	79.866	1,73		Summe Chile	28.805	0,63
BRASILIEN				CHINA			
5.350	Alpargatas SA	27.847	0,60	17.000	China Construction Bank Corp.	17.459	0,38
665	Azul SA	7.643	0,17	12.500	China Merchants Bank Company Limited - H	51.205	1,11
2.020	B3 SA Brasil Bolsa Balcao	16.222	0,35	248	Ctrip.com International Limited - ADR	11.562	0,25
7.344	Cyrela Brazil Realty SA	33.785	0,73	121.000	Industrial & Commercial Bank of China - H	103.758	2,24
280	Fibria Celulose SA	5.479	0,12	9.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	96.594	2,09
2.582	Fleury SA	21.084	0,46		Summe China	280.578	6,07
3.094	Itau Unibanco Holding SA - ADR	48.266	1,05				
4.431	Localiza Rent a Car	38.289	0,83		KOLUMBIEN		
821	M Dias Branco SA	12.600	0,28	976	Bancolombia SA - ADR	41.012	0,89
8.768	Petroleo Brasileiro SA - ADR	113.896	2,46		Summe Kolumbien	41.012	0,89
5.648	Transmissora Alianca Energia Eletrica SA	36.927	0,80				
	Summe Brasilien	362.038	7,85				
KANADA				CYPRUS			
1.736	First Quantum Minerals Limited	24.359	0,53	1.414	Tcs Group Holding plc - Reg	31.037	0,67
1.334	Parex Resources Inc.	18.749	0,41		Summe Cyprus	31.037	0,67
	Summe Kanada	43.108	0,94				
KAIMANINSELN				TSCHECHISCHE REPUBLIK			
1.629	Alibaba Group Holding Limited	298.986	6,47	2.013	Komerčni Banka AS	91.772	1,98
200	Baidu.com - ADR	44.638	0,97		Summe Tschechische Republik	91.772	1,98
3.000	Hengan International Group Company Limited	27.789	0,60				
75	Netease.com - ADR	21.029	0,46		HONGKONG		
611	New Oriental Education & Technology Group - ADR	53.555	1,15	4.000	CSPC Pharmaceutical Group Limited	10.626	0,23
18.000	Nexteer Automotive Group Limited	27.109	0,59	3.000	Techtronic Industries Company	17.488	0,38
1.224	Pagseguro Digital Limited	46.904	1,01		Summe Hongkong	28.114	0,61
1.500	Sunny Optical Technology Group Company Limited	27.694	0,60				
5.600	Tencent Holdings Limited	292.262	6,32				
6.000	Wuxi Biologics Cayman Inc.	57.682	1,25				
	Summe Kaimaninseln	897.648	19,42				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
INDIEN				POLEN			
6.676	Adani Ports & Special Economic Zone Limited	36.244	0,79	326	Bank Pekao SA	11.735	0,25
820	Bajaj Finance Limited	22.222	0,48	2.305	Dino Polska SA	58.444	1,27
68	Eicher Motors Limited	29.581	0,64	Summe Polen			
3.142	Future Retail Limited	26.534	0,57	70.179 1,52			
574	HDFC Bank Limited - ADR	56.694	1,23	SÜDKOREA			
293	Hero Honda Motors Limited	15.915	0,34	119	E-Mart Company Limited	30.199	0,65
3.791	Icici Bank Limited - ADR	33.550	0,73	485	KB Financial Group Inc.	28.029	0,61
9.045	Indraprastha Gas Limited	38.754	0,84	68	Naver Corp.	50.143	1,09
1.689	Infosys Technologies Limited - ADR	30.149	0,65	141	Posco	44.579	0,97
1.204	Larsen & Toubro Limited - GDR	24.200	0,52	130	Samsung Electronics Company Limited	299.051	6,49
2.826	Mahindra & Mahindra Limited	32.015	0,70	244	Samsung Sdi Company Limited	43.722	0,95
383	Ultra Tech Cement Limited	23.195	0,50	1.645	SK hynix Inc.	123.926	2,68
Summe Indien		369.053	7,99	Summe Südkorea		619.649	13,44
INDONESIEN				RUSSISCHE FÖDERATION			
28.100	Bank Central Asia Tbk Pt	47.553	1,03	914	Novolipet Steel Reg.	22.759	0,49
125.000	Bank Rakyat Indonesia	32.684	0,71	4.854	Sberbank - ADR	90.430	1,96
Summe Indonesien		80.237	1,74	321	X5 Retail Group NV - GDR - Reg	10.786	0,23
Summe Indonesien		80.237	1,74	Summe Russische Föderation		123.975	2,68
ITALIEN				SÜDAFRIKA			
5.500	Prada SpA	25.404	0,55	3.722	Avi Limited	34.811	0,75
Summe Italien		25.404	0,55	1.726	Discovery Holdings Limited	24.837	0,54
Summe Italien		25.404	0,55	1.540	Imperial Holdings Limited	30.316	0,66
LUXEMBURG				1.349	Mr Price Group Limited	32.448	0,70
11.400	Samsonite International SA	51.856	1,12	715	Naspers Limited	174.505	3,78
Summe Luxemburg		51.856	1,12	3.887	Standard Bank Group Limited	71.738	1,55
Summe Luxemburg		51.856	1,12	Summe Südafrika		368.655	7,98
MEXIKO				TAIWAN			
7.679	Alsea SAB de CV	26.726	0,58	24.000	Cathay Financial Holding Company Limited	42.638	0,92
5.406	Cemex SAB de CV - ADR	35.788	0,78	51.927	E.Sun Financial Holding Company Limited	34.906	0,75
7.801	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	47.494	1,03	14.000	Hon Hai Precision Industry Company Limited	43.214	0,94
Summe Mexiko		110.008	2,39	5.000	President Chain Store Corp.	50.245	1,09
Summe Mexiko		110.008	2,39	4.584	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited - ADR	200.596	4,34
NIEDERLANDE				895	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	7.490	0,16
1.480	Yandex NV - A	58.386	1,26	Summe Taiwan		379.089	8,20
Summe Niederlande		58.386	1,26	Summe Taiwan			
Summe Niederlande		58.386	1,26	379.089 8,20			
PHILIPPINEN							
81.900	Metro Pacific Investments Corp.	8.225	0,18				
15.335	Metropolitan Bank & Trust	25.216	0,55				
Summe Philippinen		33.441	0,73				
Summe Philippinen		33.441	0,73				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien			
THAILAND				RUSSISCHE FÖDERATION			
10.700	Central Pattana pcl	26.862	0,58	7.600	Aeroflot-Russian Airlines	20.381	0,44
9.000	Kasikornbank pcl - NVDR	61.018	1,32				
130.600	Land & Houses pcl - NVDR	44.272	0,96		Summe Russische Föderation	20.381	0,44
30.500	Muangthai Leasing pcl	37.064	0,81				
1.700	PTT pcl	29.793	0,65		Summe Aktien	20.381	0,44
	Summe Thailand	199.009	4,32		Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt	20.381	0,44
TÜRKEI							
2.711	Tofas Turk Otomobil Fabrik	18.135	0,39		Wert der Anlagen, insgesamt	4.548.101	98,51
	Summe Türkei	18.135	0,39				
VEREINIGTES KÖNIGREICH							
4.058	DP Eurasia NV	11.414	0,25		(Gesamtkosten: USD 3.878.670)		
	Summe Vereinigtes Königreich	11.414	0,25				
VEREINIGTE STAATEN							
113	Universal Display Corp.	11.413	0,25				
	Summe Vereinigte Staaten	11.413	0,25				
BRITISCHE JUNGFERNINSELN							
483	Despegar.com Corp.	15.094	0,33				
405	Mail.Ru Group Limited - GDR	14.167	0,31				
	Summe Britische Jungferninseln	29.261	0,64				
	Summe Aktien	4.443.142	96,24				
Optionsscheine Aktien							
LUXEMBURG							
7.874	Wuliangye Yibin Company Limited - Wts 02/07/2020 Str.0,01	84.578	1,83				
	Summe Luxemburg	84.578	1,83				
	Summe Optionsscheine Aktien	84.578	1,83				
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	4.527.720	98,07				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
AUSTRALIEN				ITALIEN			
15.080	Ansell Limited	237.578	0,82	3.958	Diasorin SpA	289.330	0,99
	Summe Australien	237.578	0,82	5.699	El Towers SpA	259.589	0,89
BERMUDAS				56.281	Finecobank Banca Fineco SpA	549.752	1,89
19.096	Axalta Coating System Limited	468.762	1,61	69.413	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	446.326	1,53
	Summe Bermudas	468.762	1,61		Summe Italien	1.544.997	5,30
KANADA				JAPAN			
13.570	Cargojet Inc.	583.766	2,00	10.900	Anicom Holdings Inc.	364.598	1,25
17.161	Gildan Activewear Inc.	402.729	1,38	18.100	Benefit One Inc.	403.115	1,38
17.897	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	457.957	1,57	7.600	Daifuku Company Limited	359.678	1,24
	Summe Kanada	1.444.452	4,95	9.600	Digital Arts Inc.	293.590	1,01
DÄNEMARK				15.400	JCU Corp.	292.589	1,00
5.422	Simcorp A/S	305.360	1,05	14.600	Nihon M&A Center Inc.	405.758	1,39
	Summe Dänemark	305.360	1,05	9.981	Osg Corp.	183.069	0,63
FINNLAND				16.000	Relo Holdings Inc.	358.792	1,23
4.726	Basware Oyj	206.526	0,71	9.100	Seria Company Limited	363.180	1,25
	Summe Finnland	206.526	0,71	2.000	Sho-Bond Holdings Company Limited	119.883	0,41
FRANKREICH				8.700	Sohgo Security Services Company Limited	343.890	1,18
10.280	Edenred	290.307	1,00		Summe Japan	3.488.142	11,97
27.925	Elis SA	561.294	1,93	LUXEMBURG			
1.442	Orpea	148.887	0,51	624	Eurofins Scientific	267.696	0,93
	Summe Frankreich	1.000.488	3,44		Summe Luxemburg	267.696	0,93
DEUTSCHLAND				NIEDERLANDE			
6.463	CTS Eventim AG	245.982	0,84	3.284	Core Laboratories NV	288.974	0,99
3.233	Grenkeleasing AG	278.361	0,96	5.637	IMCD Group NV	281.399	0,97
5.564	Norma Group	338.291	1,16	7.100	Takeaway.com Holding BV	306.720	1,05
2.962	Sartorius AG	336.187	1,16		Summe Niederlande	877.093	3,01
27.641	Tele Columbus AG	242.412	0,83	SPANIEN			
	Summe Deutschland	1.441.233	4,95	25.639	Applus Services SA	271.261	0,93
INDIEN				20.152	Cellnex Telecom SAU	437.097	1,50
18.524	Colgate-Palmolive Company	244.071	0,84	17.314	Lar Espana Real Estate SA	168.812	0,58
477	Eicher Motors Limited	168.719	0,58		Summe Spanien	877.170	3,01
10.913	IndusInd Bank Limited	244.443	0,84	SCHWEDEN			
	Summe Indien	657.233	2,26	62.909	Ahlsell AB	320.966	1,10
IRLAND				6.413	Avanza AB	274.085	0,94
38.250	Dalata Hotel Group Limited	237.150	0,81	37.573	Dometic Group AB	278.157	0,96
	Summe Irland	237.150	0,81		Summe Schweden	873.208	3,00

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
SCHWEIZ				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
69	Belimo Holding AG - Reg	226.445	0,78	2.702	WD-40 Company	289.347	0,99
37	Sika AG	235.157	0,81	8.997	Welbilt Inc.	142.287	0,49
	Summe Schweiz	461.602	1,59	4.607	Zebra Technologies Corp.	521.404	1,78
					Summe Vereinigte Staaten	12.672.845	43,50
VEREINIGTES KÖNIGREICH				Summe Aktien			
79.704	Ascential plc	378.923	1,31			28.567.397	98,09
32.952	Big Yellow Group plc	320.608	1,10	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind			
9.376	Genus plc	249.182	0,86			28.567.397	98,09
8.989	Rathbone Brothers plc	250.176	0,86	Wert der Anlagen, insgesamt			
10.480	Victrex plc	306.973	1,05			28.567.397	98,09
	Summe Vereinigtes Königreich	1.505.862	5,18	(Gesamtkosten: EUR 26.208.186)			
VEREINIGTE STAATEN							
32.326	American Homes 4 Rent - A	527.792	1,82				
1.744	Ansys Inc.	222.196	0,76				
14.199	BankUnited Inc.	461.582	1,58				
10.671	Blackline Inc.	340.212	1,17				
7.464	Booz Allen Hamilton Holding Corp.	234.993	0,81				
8.614	Cadence Design Systems Inc.	257.541	0,88				
8.706	Catalent Inc.	290.660	1,00				
8.051	CNO Financial Group Inc.	141.859	0,49				
1.733	Cooper Companies Inc.	322.419	1,11				
5.565	Cubic Corp.	287.786	0,99				
10.391	Cyrusone Inc.	432.673	1,49				
17.443	Elf Beauty Inc.	274.725	0,94				
4.220	Fair Isaac Corp.	581.162	2,01				
7.779	Gatx Corp.	433.211	1,49				
8.243	Glaukos Corp.	206.636	0,71				
10.185	Graco Inc.	378.630	1,30				
1.817	JB Hunt Transport Services Inc.	173.079	0,59				
10.858	Macom Technology Solutions	146.557	0,50				
9.142	Medpace Holdings Inc.	259.501	0,89				
4.360	MSA Safety Inc.	295.098	1,01				
4.896	Pool Corp.	582.098	2,00				
5.374	PRA Health Sciences Inc.	362.505	1,24				
8.925	PTC Inc.	566.117	1,94				
16.912	Service Corp. International	518.973	1,78				
8.288	SiteOne Landscape Supply Inc.	519.175	1,78				
1.342	Svb Financial Group	261.897	0,90				
9.262	Transunion	427.610	1,47				
4.733	Trex Company Inc.	418.594	1,43				
9.898	Trimble Navigation Limited	288.767	0,99				
2.847	Tyler Technologies Inc.	488.355	1,68				
3.980	Wabco Holdings Inc.	433.226	1,48				
3.970	Watsco Inc.	584.178	2,01				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Select

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
IRLAND				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
2.291	Ingersoll-Rand plc	195.903	2,09	1.212	Vertex Pharmaceuticals Inc.	197.532	2,11
1.960	Medtronic Inc.	157.231	1,68	4.180	Visa Inc. - A	500.012	5,35
	Summe Irland	353.134	3,77	13.385	WPX Energy Inc.	197.830	2,12
SINGAPUR				Summe Vereinigte Staaten			
1.101	Broadcom Limited	259.451	2,77		Summe Aktien	9.294.371	99,36
	Summe Singapur	259.451	2,77	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind			
VEREINIGTE STAATEN				Wert der Anlagen, insgesamt			
1.611	Adobe Systems Inc.	348.105	3,72	(Gesamtkosten: USD 8.099.926)			
2.212	Alexion Pharmaceuticals Inc.	246.550	2,64			9.294.371	99,36
594	Alphabet Inc. - A	616.062	6,59				
236	Amazon.com Inc.	341.572	3,65				
1.093	Analog Devices Inc.	99.605	1,06				
1.326	Apple Inc.	222.476	2,38				
14.661	Bank of America Corp.	439.683	4,70				
3.010	Berkshire Hathaway Inc.	600.435	6,42				
914	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	74.098	0,79				
722	Boeing Company	236.729	2,53				
2.507	Celgene Corp.	223.649	2,39				
343	Charter Communications Inc. - A	106.748	1,14				
1.412	Cigna Corp.	236.849	2,53				
7.129	Comcast Corp.	243.598	2,60				
2.592	DowDupont Inc.	165.136	1,77				
378	Edwards Lifesciences Corp.	52.739	0,56				
1.125	Electronic Arts Inc.	136.395	1,46				
966	Eog Resources Inc.	101.691	1,09				
525	Facebook Inc. - A	83.890	0,90				
1.547	Gilead Sciences Inc.	116.628	1,25				
859	Goldman Sachs Group Inc.	216.348	2,31				
3.515	Halliburton Company	164.994	1,76				
3.106	JPMorgan Chase & Company	341.567	3,65				
453	L3 Technologies Inc.	94.224	1,01				
2.140	Lam Research Corp.	434.762	4,65				
477	Lockheed Martin Corp.	161.193	1,72				
2.187	Macom Technology Solutions	36.304	0,39				
7.282	Microsoft Corp.	664.628	7,11				
1.216	Norfolk Southern Corp.	165.108	1,77				
753	Paypal Holdings Inc.	57.130	0,61				
1.191	PepsiCo Inc.	129.998	1,39				
1.574	Phillips 66	150.978	1,61				
1.449	PNC Financial Services	219.147	2,34				
1.265	Tesaro Inc.	72.282	0,77				
454	Thermo Fisher Scientific Inc.	93.733	1,00				
427	UnitedHealth Group Inc.	91.378	0,98				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
THAILAND			
296.400	Bangkok Bank plc - NVDR	1.876.817	0,98
390.100	Siam Commercial Bank plc - NVDR	1.790.220	0,94
	Summe Thailand	3.667.037	1,92
VEREINIGTES KÖNIGREICH			
128.300	Standard Chartered Bank	1.292.268	0,68
	Summe Vereinigtes Königreich	1.292.268	0,68
	Summe Aktien	175.990.708	92,19
Optionsscheine Aktien			
LUXEMBURG			
353.297	Wuliangye Yibin Company Limited - Wts 02/07/2020 Str.0,01	3.794.933	1,99
	Summe Luxemburg	3.794.933	1,99
VEREINIGTE STAATEN			
1.131.073	JPMorgan BV on Baoshan Iron & Steel - Wts 30/04/2020 Str.0,01	1.555.122	0,81
	Summe Vereinigte Staaten	1.555.122	0,81
	Summe Optionsscheine Aktien	5.350.055	2,80
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	181.340.763	94,99
	Wert der Anlagen, insgesamt	181.340.763	94,99
(Gesamtkosten: USD 165.651.305)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asian Focus

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BERMUDAS				SÜDKOREA			
36.000	Brilliance China Automotive Holdings Limited	75.135	1,16	3.593	Hana Financial Group Inc.	153.711	2,37
	Summe Bermudas	75.135	1,16	766	Hyundai Heavy Industries Company Limited	98.813	1,52
KAIMANINSELN				625	LG Chem Limited	126.360	1,95
1.950	58.com Inc. - ADR	155.727	2,40	1.339	LG Innotek Company Limited	155.142	2,39
2.577	Alibaba Group Holding Limited	472.982	7,29	577	Pearlabyss Corp.	116.872	1,80
3.058	Baozun Inc. - ADR	140.301	2,16	1.307	Samsung Company Limited	104.716	1,61
38.400	Mgm China Holdings Limited	99.079	1,53	169	Samsung Electronics Company Limited	388.766	5,99
7.800	Tencent Holdings Limited	407.079	6,27	432	Shinsegae Company Limited	141.243	2,18
66.000	Times Property Holdings Limited	100.913	1,55		Summe Südkorea	1.285.623	19,81
	Summe Kaimaninseln	1.376.081	21,20	SINGAPUR			
CHINA				9.000	DBS Group Holdings Limited	188.744	2,91
365.000	Bank of China Limited - H	196.259	3,02	36.300	Singapore Airport Terminal Services Limited	142.011	2,19
342.000	BBMG Corp.	154.260	2,38	6.200	United Overseas Bank Limited	130.024	2,00
363.000	China Construction Bank Corp.	372.791	5,75		Summe Singapur	460.779	7,10
24.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	244.027	3,76	TAIWAN			
	Summe China	967.337	14,91	69.000	Cathay Financial Holding Company Limited	122.584	1,89
HONGKONG				10.000	Kingpak Technology Inc.	79.912	1,23
34.400	Aia Group Limited	291.039	4,48	1.000	Largan Precision Company Limited	113.695	1,75
48.000	Guangdong Investment Limited	75.471	1,16	18.000	MediaTek Inc.	204.342	3,15
3.700	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	120.311	1,85	40.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	334.739	5,16
374.000	Sinopec Kantons Holdings Limited	184.419	2,84		Summe Taiwan	855.272	13,18
	Summe Hongkong	671.240	10,33	THAILAND			
INDIEN				650.100	TPI Polene Power pcl	143.452	2,21
5.013	Reliance Industries Limited - GDR	135.852	2,09		Summe Thailand	143.452	2,21
10.208	Tata Steel Limited - GDR	88.605	1,37	Summe Aktien			
	Summe Indien	224.457	3,46	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind			
MALAYSIA				6.198.578			
75.200	Cimb Group Holdings Bhd	139.202	2,14	95,50			
	Summe Malaysia	139.202	2,14	Wert der Anlagen, insgesamt			
				6.198.578			
				95,50			
				(Gesamtkosten: USD 5.134.119)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
AUSTRALIEN				HONGKONG			
19.443	Australia & New Zealand Banking Group Limited	400.583	1,80	204.200	Aia Group Limited	1.727.618	7,77
26.307	Bhp Billiton Limited	569.244	2,56	39.000	Boc Hong Kong Holdings Limited	189.824	0,85
19.037	Caltex Australia Limited	458.513	2,06	52.000	China Overseas Land & Investment Limited	180.548	0,81
18.140	Lendlease Group	240.856	1,08	29.600	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	962.490	4,33
3.479	Macquarie Group Limited	274.596	1,23	74.500	Power Assets Holdings Limited	664.000	2,98
74.852	QBE Insurance Group Limited	552.909	2,48	118.000	Shangri-La Asia Limited	237.554	1,07
43.443	Star Entertainment Grp Limited	176.278	0,79	682.000	Sinopec Kantons Holdings Limited	336.294	1,51
14.111	Westpac Banking Corp.	309.778	1,39	17.000	Sun Hung Kai Properties Limited	268.593	1,21
	Summe Australien	2.982.757	13,39		Summe Hongkong	4.566.921	20,53
BERMUDAS				MACAU			
92.000	Brilliance China Automotive Holdings Limited	192.011	0,86	178.000	Wynn Macau Limited	645.247	2,90
	Summe Bermudas	192.011	0,86		Summe Macau	645.247	2,90
KAIMANINSELN				SÜDKOREA			
3.594	58.com Inc. - ADR	287.017	1,29	2.210	LG Innotek Company Limited	256.059	1,15
1.181	Alibaba Group Holding Limited	216.761	0,97	1.153	Shinsegae Company Limited	376.976	1,69
5.042	Baozun Inc. - ADR	231.327	1,04		Summe Südkorea	633.035	2,84
73.500	CK Asset Holdings Limited	616.691	2,77	SINGAPUR			
48.000	CK Hutchison Holdings Limited	574.289	2,58	265.900	Capitaretail China Trust	320.386	1,44
118.000	Mgm China Holdings Limited	304.461	1,37	94.900	DBS Group Holdings Limited	1.990.202	8,93
90.400	Sands China Limited	486.077	2,18	68.200	Keppel Corp. Limited	404.113	1,82
191.000	Times Property Holdings Limited	292.037	1,31	165.484	Oversea-Chinese Banking Corp. Limited	1.617.864	7,27
	Summe Kaimaninseln	3.008.660	13,51	132.300	Singapore Airport Terminal Services Limited	517.578	2,33
CHINA				242.900	Singapore Telecommunications Limited	624.245	2,80
1.485.000	Bank of China Limited - H	798.478	3,59	84.035	United Overseas Bank Limited	1.762.345	7,92
498.000	BBMG Corp.	224.624	1,01		Summe Singapur	7.236.733	32,51
349.000	Beijing Urban Construction Design & Development Group Company Limited	193.881	0,87	TAIWAN			
257.000	China Construction Bank Corp.	263.932	1,19	126.000	King Yuan Electronics Company Limited	130.723	0,59
32.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	330.453	1,48	2.000	Largan Precision Company Limited	227.389	1,02
	Summe China	1.811.368	8,14	17.000	MediaTek Inc.	192.989	0,86
					Summe Taiwan	551.101	2,47

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTES KÖNIGREICH			
16.800	Standard Chartered Bank	169.214	0,76
	Summe Vereinigtes Königreich	169.214	0,76
	Summe Aktien	21.797.047	97,91
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	21.797.047	97,91
	Wert der Anlagen, insgesamt	21.797.047	97,91
(Gesamtkosten: USD 19.118.887)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
253.676	Verizon Communications Inc.	12.130.786	1,21
29.092	Vertex Pharmaceuticals Inc.	4.741.413	0,47
	Summe Vereinigte Staaten	882.090.141	88,29
	Summe Aktien	972.197.532	97,31
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	972.197.532	97,31
	Wert der Anlagen, insgesamt	972.197.532	97,31
(Gesamtkosten: USD 824.787.258)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities*

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
LIBERIA				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
650	Royal Caribbean Cruises Limited	76.531	1,36	2.240	Centerpoint Energy Inc.	61.376	1,09
	Summe Liberia	76.531	1,36	257	Charter Communications Inc. - A	79.984	1,42
NIEDERLANDE				242	Chevron Corp.	27.598	0,49
1.002	Lyondellbasell Industries NV - A	105.891	1,87	3.350	Cisco Systems Inc.	143.682	2,55
	Summe Niederlande	105.891	1,87	1.940	Citigroup Inc.	130.950	2,32
SINGAPUR				560	Citizens Financial Group Inc.	23.509	0,42
482	Broadcom Limited	113.583	2,02	620	Comcast Corp.	21.185	0,38
	Summe Singapur	113.583	2,02	2.075	Conocophillips	123.026	2,17
VEREINIGTES KÖNIGREICH				212	Cummins Inc.	34.363	0,61
151	Aon plc	21.190	0,38	1.305	CVS Health Corp.	81.184	1,44
100	Nielsen Holdings plc	3.179	0,06	175	Eastman Chemical Company	18.477	0,33
	Summe Vereinigtes Königreich	24.369	0,44	660	Electronic Arts Inc.	80.018	1,42
VEREINIGTE STAATEN				1.335	Eli Lilly & Company	103.289	1,83
305	Activision Blizzard Inc.	20.575	0,36	835	Entergy Corp.	65.781	1,17
47	Acuity Brands Inc.	6.542	0,12	1.365	Express Scripts Inc.	94.294	1,67
601	Adobe Systems Inc.	129.864	2,30	370	F5 Networks Inc.	53.506	0,95
250	Alexion Pharmaceuticals Inc.	27.865	0,49	1.180	Facebook Inc. - A	188.552	3,34
1.035	Allstate Corp.	98.117	1,73	345	Franklin Resources Inc.	11.965	0,21
59	Alphabet Inc. - A	61.191	1,08	600	Freeport-McMoRan Copper & Gold	10.542	0,19
1.030	Altria Group Inc.	64.190	1,14	344	General Dynamics Corp.	75.990	1,35
36	Amazon.com Inc.	52.104	0,92	300	Gilead Sciences Inc.	22.617	0,40
719	American Tower Corp.	104.499	1,85	314	Grainger (WWW) Inc.	88.633	1,57
140	Amerisourcebergen Corp.	12.069	0,21	353	Home Depot Inc.	62.919	1,12
450	Ametek Inc.	34.186	0,60	262	Honeywell International Inc.	37.862	0,67
714	Apple Inc.	119.795	2,11	940	HP inc.	20.605	0,37
755	Applied Materials Inc.	41.986	0,74	80	Humana Inc.	21.506	0,38
2.730	AT&T Inc.	97.325	1,72	285	Johnson & Johnson	36.523	0,65
71	Avery Dennison Corp.	7.544	0,13	1.725	JPMorgan Chase & Company	189.697	3,36
1.840	Bank of America Corp.	55.182	0,98	321	Kimberly-Clark Corp.	35.352	0,63
1.220	Baxter International Inc.	79.349	1,41	470	Liberty Media Corp. - Interactive	11.830	0,21
1.510	Best Buy Company Inc.	105.684	1,87	168	Lockheed Martin Corp.	56.772	1,01
100	Biogen Idec Inc.	27.382	0,49	545	Marathon Petroleum Corp.	39.845	0,71
125	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	10.134	0,18	750	Mastercard Inc. - A	131.370	2,33
198	Blackrock Inc.	107.260	1,90	1.000	Merck & Company Inc.	54.470	0,97
435	Boeing Company	142.628	2,52	350	Micron Technology Inc.	18.249	0,32
4	Booking Holdings Inc.	8.322	0,15	1.545	Microsoft Corp.	141.013	2,50
400	Bristol-Myers Squibb Company	25.300	0,45	410	National Oilwell Varco Inc.	15.092	0,27
290	Cadence Design Systems Inc.	10.663	0,19	335	Network Appliance	20.666	0,37
145	Campbell Soup Company	6.280	0,11	2.500	News Corp. - A	39.500	0,70
230	Celgene Corp.	20.518	0,36	75	Packaging Corp. of America	8.453	0,15
534	Centene Corp.	57.069	1,01	4.040	Pfizer Inc.	143.379	2,54
				295	Procter & Gamble Company	23.388	0,41
				450	Prudential Financial Inc.	46.598	0,83
				1.050	Pulte Homes Inc.	30.965	0,55
				900	Ralph Lauren Corp.	100.620	1,78
				600	S&P Global Inc.	114.636	2,03

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities*

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
261	SBA Communications	44.610	0,79
1.300	Southwest Airlines Company	74.464	1,32
335	T Rowe Price Group Inc.	36.170	0,64
1.230	Target Corp.	85.398	1,51
110	Tesaro Inc.	6.285	0,11
1.280	Tyson Foods Inc. - A	93.683	1,66
201	Union Pacific Corp.	27.020	0,48
1.215	Valero Energy Corp.	112.716	2,00
875	VeriSign Inc.	103.740	1,84
195	Vertex Pharmaceuticals Inc.	31.781	0,57
180	VF Corp.	13.342	0,24
56	Visa Inc. - A	6.699	0,12
830	Walgreens Boots Alliance Inc.	54.340	0,96
870	Wal-Mart Stores Inc.	77.404	1,37
760	Xcel Energy Inc.	34.565	0,61
	Summe Vereinigte Staaten	5.277.671	93,52
	Summe Aktien	5.598.045	99,21
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	5.598.045	99,21
	Wert der Anlagen, insgesamt	5.598.045	99,21
	(Gesamtkosten: USD 5.110.324)		

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BELGIEN				ITALIEN			
7.699	Anheuser-Busch InBev SA/NV	687.367	1,06	33.725	Moncler SpA	1.042.103	1,61
5.151	Galapagos NV	418.776	0,65	100.677	Pirelli & Company SpA	724.874	1,12
22.061	KBC Bank	1.560.154	2,41	49.166	Prysmian SpA	1.253.733	1,93
	Summe Belgien	2.666.297	4,12	82.254	Unicredit SpA	1.397.331	2,16
					Summe Italien	4.418.041	6,82
DÄNEMARK				NIEDERLANDE			
43.449	Novo-Nordisk A/S	1.734.114	2,68	11.797	Airbus Group NV 0.00%	1.106.559	1,71
	Summe Dänemark	1.734.114	2,68	12.735	ASML Holding NV	2.039.510	3,15
				7.226	Ferrari NV	704.824	1,09
FINNLAND				123.572	ING Groep NV	1.692.936	2,62
28.983	Sampo Oyj - A	1.311.771	2,03	83.866	RELX NV	1.411.465	2,18
	Summe Finnland	1.311.771	2,03		Summe Niederlande	6.955.294	10,75
FRANKREICH				NORWEGEN			
24.021	Amundi SA	1.567.610	2,43	97.485	Dnb ASA	1.536.155	2,38
20.185	BNP Paribas	1.214.531	1,88		Summe Norwegen	1.536.155	2,38
15.579	Dassault Systemes SA	1.719.921	2,66				
9.571	Essilor International SA	1.048.981	1,62	SPANIEN			
17.922	Legrand SA	1.141.631	1,77	21.258	Amadeus IT Holding SA - A	1.275.055	1,97
6.997	L'Oreal SA	1.282.900	1,98	55.979	Cellnex Telecom SAU	1.214.185	1,88
6.048	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	1.513.210	2,34	55.995	Grifols SA	1.288.445	1,99
4.905	Pernod-Ricard SA	663.401	1,03	33.702	Inditex SA	857.042	1,33
9.145	Vinci SA	730.686	1,13		Summe Spanien	4.634.727	7,17
	Summe Frankreich	10.882.871	16,84				
				SCHWEDEN			
DEUTSCHLAND				53.815	Atlas Companypc AB - B	1.887.231	2,92
9.390	Adidas AG	1.846.543	2,86	24.333	Intrum Justitia AB	559.201	0,86
7.900	Allianz SE - Reg	1.448.860	2,24	104.526	Volvo AB - B	1.545.097	2,39
4.392	Continental AG	985.126	1,52		Summe Schweden	3.991.529	6,17
20.862	Fresenius Medical Care AG & Company KGaA	1.731.129	2,68				
13.978	SAP SE	1.187.711	1,84	SCHWEIZ			
	Summe Deutschland	7.199.369	11,14	227	Sika AG	1.442.717	2,23
					Summe Schweiz	1.442.717	2,23
IRLAND							
52.623	CRH plc	1.445.959	2,24				
42.342	Kingspan Group plc	1.456.565	2,25				
130.972	Ryanair Holdings plc	2.096.862	3,24				
28.771	Smurfit Kappa Group plc	945.785	1,46				
	Summe Irland	5.945.171	9,19				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTES KÖNIGREICH			
126.201	3i Group plc	1.236.516	1,91
28.508	British American Tobacco plc	1.343.277	2,08
285.114	Convatec Group plc	647.491	1,00
135.275	John Wood Group plc	833.211	1,29
98.386	Prudential plc	1.995.863	3,10
31.866	Rio Tinto plc	1.312.498	2,03
48.911	Royal Dutch Shell plc - B	1.270.320	1,96
98.741	Sophos Group plc	487.448	0,75
85.830	Standard Chartered plc	697.733	1,08
39.037	Unilever plc	1.761.252	2,72
	Summe Vereinigtes Königreich	11.585.609	17,92
	Summe Aktien	64.303.665	99,44
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	64.303.665	99,44
	Wert der Anlagen, insgesamt	64.303.665	99,44
(Gesamtkosten: EUR 58.405.095)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
ÖSTERREICH				DEUTSCHLAND			
43.551	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	3.891.282	0,74	165.391	Brenntag AG	7.988.385	1,52
				63.567	Compugroup Holding AG	2.793.134	0,53
	Summe Österreich	3.891.282	0,74	186.266	CTS Eventim AG	7.089.284	1,35
				58.512	Grenkeleasing AG	5.037.883	0,96
BELGIEN				157.876	Norma Group	9.598.861	1,82
72.003	Kinopolis Group NV	3.880.962	0,74	81.312	Sartorius AG	9.228.913	1,75
62.634	Melexis NV	5.073.354	0,96	79.282	Stabilus GmbH	6.148.320	1,17
120.054	Telenet Group Holding NV	6.512.930	1,24	102.375	Stratec Biomedical AG	7.514.325	1,43
105.801	Umicore SA	4.542.037	0,86	887.890	Tele Columbus AG	7.786.795	1,48
745.779	X-Fab	6.525.566	1,24	17.164	Zooplus AG	2.540.272	0,48
	Summe Belgien	26.534.849	5,04		Summe Deutschland	65.726.172	12,49
DÄNEMARK				IRLAND			
220.616	Ambu A/S - B	4.037.031	0,77	1.163.045	Dalata Hotel Group Limited	7.210.879	1,37
56.055	Christian Hansen Holding A/S	3.917.985	0,74	1.331.702	Irish Continental Group plc	7.617.335	1,44
128.583	Simcorp A/S	7.241.637	1,38	299.409	Kingspan Group plc	10.311.647	1,96
327.118	Tryg A/S	6.165.829	1,17	54.280	Paddy Power plc	4.529.665	0,86
	Summe Dänemark	21.362.482	4,06		Summe Irland	29.669.526	5,63
FINNLAND				ITALIEN			
110.389	Basware Oyj	4.823.999	0,92	1.735.118	Davide Campari-Milano SpA	10.670.976	2,03
104.434	Cargotec Corp.	4.517.815	0,86	143.989	Diasorin SpA	10.525.596	2,00
251.323	Huhtamaki Oyj	8.957.152	1,70	164.767	El Towers SpA	7.505.137	1,42
113.432	Konecranes Oyj	3.997.343	0,76	1.067.941	Fincobank Banca Fineco SpA	10.431.648	1,98
285.606	Tikkurila Oyj	4.461.166	0,85	22.192	Industria Macchine Automatiche SpA	1.754.278	0,33
86.185	Vaisala Oyj	3.740.429	0,71	1.695.747	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	10.903.653	2,07
	Summe Finnland	30.497.904	5,80	302.676	Marr SpA	7.306.599	1,39
FRANKREICH				868.327	Pirelli & Company SpA	6.251.954	1,18
260.095	Bureau Veritas SA	5.490.605	1,04		Summe Italien	65.349.841	12,40
374.670	Edenred	10.580.682	2,01	LUXEMBURG			
495.012	Elis SA	9.949.742	1,89	8.227	Eurofins Scientific	3.529.383	0,67
134.588	Korian-Medica	3.701.170	0,70		Summe Luxemburg	3.529.383	0,67
146.844	Nexity	7.643.230	1,45	NIEDERLANDE			
76.648	Orpea	7.913.906	1,50	134.166	IMCD Group NV	6.697.567	1,27
18.271	Teleperformance	2.302.146	0,44	155.826	Sligro Food Group NV	6.918.675	1,31
	Summe Frankreich	47.581.481	9,03	179.588	Takeaway.com Holding BV	7.758.202	1,47
					Summe Niederlande	21.374.444	4,05
				NORWEGEN			
				844.512	XXL ASA	7.032.134	1,34
					Summe Norwegen	7.032.134	1,34

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

Aufstellung der Wertpapiieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
SPANIEN				VEREINIGTE STAATEN			
661.161	Applus Services SA	6.995.083	1,33	43.766	Autoliv Inc.	5.111.831	0,97
385.745	Cellnex Telecom SAU	8.366.809	1,59		Summe Vereinigte Staaten	5.111.831	0,97
597.609	Lar Espana Real Estate SA	5.826.688	1,11		Summe Aktien	515.663.002	97,88
	Summe Spanien	21.188.580	4,03		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	515.663.002	97,88
SCHWEDEN				Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
1.791.130	Ahlsell AB	9.138.477	1,73	Aktien			
217.747	Avanza AB	9.306.282	1,77	DÄNEMARK			
1.172.429	Cloetta AB	3.622.102	0,69	49.761	Ow Bunker A/S*	0	0,00
907.818	Dometic Group AB	6.720.671	1,28		Summe Dänemark	0	0,00
888.489	Elektro AB - B	7.682.609	1,46		Summe Aktien	0	0,00
710.977	Hexpol AB	5.339.368	1,01		Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	0	0,00
127.040	Thule Group AB	2.227.574	0,42		Wert der Anlagen, insgesamt	515.663.002	97,88
	Summe Schweden	44.037.083	8,36		(Gesamtkosten: EUR 421.696.574)		
SCHWEIZ							
1.632	Belimo Holding AG - Reg	5.355.909	1,02				
18.797	Burckhardt Compression Holding AG	4.864.823	0,92				
1.844	LEM Holding SA	2.489.554	0,47				
1.533	Sika AG	9.743.108	1,85				
	Summe Schweiz	22.453.394	4,26				
VEREINIGTES KÖNIGREICH							
1.664.898	Ascential plc	7.915.147	1,50				
157.630	Aveva Group plc	3.435.921	0,65				
691.087	Big Yellow Group plc	6.723.964	1,27				
5.577.029	Coats Group plc	4.872.763	0,92				
225.061	Crest Nicholson Holdings plc	1.166.493	0,22				
630.739	Cvs Group plc	7.025.311	1,33				
91.638	Dechra Pharmaceuticals plc	2.746.911	0,52				
235.636	Genus plc	6.262.406	1,19				
1.499.423	Howden Joinery Group plc	7.880.981	1,50				
1.837.990	Ibstock plc	5.912.020	1,12				
3.383.468	Johnson Service Group plc	5.225.458	0,99				
548.406	Just Eat plc	4.368.678	0,83				
936.005	Merlin Entertainments plc	3.700.415	0,70				
144.659	Rightmove plc	7.172.636	1,36				
438.718	St James's Place plc	5.436.994	1,03				
1.859.793	Tyman plc	6.321.564	1,20				
617.378	Victoria plc	5.225.149	0,99				
304.862	Victrex plc	8.929.805	1,69				
	Summe Vereinigtes Königreich	100.322.616	19,01				

*Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Select

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BELGIEN				ITALIEN			
13.741	Anheuser-Busch InBev SA/NV	1.226.796	3,72	139.021	Davide Campari-Milano SpA	854.979	2,60
8.863	KBC Bank	626.792	1,91	81.952	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	526.951	1,60
12.050	Telenet Group Holding NV	653.713	1,98	17.445	Prysmian SpA	444.848	1,35
	Summe Belgien	2.507.301	7,61		Summe Italien	1.826.778	5,55
DÄNEMARK				NIEDERLANDE			
7.917	DSV A/S	503.761	1,53	4.396	ASML Holding NV	704.019	2,14
16.161	Novo-Nordisk A/S	645.009	1,96	20.175	IMCD Group NV	1.007.136	3,06
	Summe Dänemark	1.148.770	3,49	99.239	RELX NV	1.670.192	5,07
FINNLAND				SPANIEN			
11.541	Kone Oyj	467.757	1,42	38.169	Unilever NV	1.750.813	5,32
29.867	Sampo Oyj - A	1.351.780	4,10		Summe Niederlande	5.132.160	15,59
	Summe Finnland	1.819.537	5,52		Summe Spanien	2.723.545	8,27
FRANKREICH				SCHWEDEN			
13.683	Dassault Systemes SA	1.510.604	4,59	36.578	Assa Abloy AB	640.487	1,94
49.882	Elis SA	1.002.628	3,04	28.701	Atlas Companypc AB - B	1.006.511	3,06
6.973	Essilor International SA	764.241	2,32	70.130	Nordea Bank AB	606.674	1,84
14.677	Legrand SA	934.924	2,84	57.126	Svenska Handelsbanken AB - A	577.930	1,75
5.487	L'Oreal SA	1.006.041	3,05		Summe Schweden	2.831.602	8,59
10.942	Pernod-Ricard SA	1.479.907	4,49		Summe Schweiz	1.328.789	4,04
	Summe Frankreich	6.698.345	20,33		Summe Aktien	32.627.927	99,06
DEUTSCHLAND				SCHWEIZ			
6.545	Adidas AG	1.287.074	3,91	9.258	Compagnie Financiere Richemont SA - Reg	674.164	2,05
5.851	BASF SE	482.532	1,46	103	Sika AG	654.625	1,99
17.244	Brenntag AG	832.885	2,53		Summe Schweiz	1.328.789	4,04
2.808	Continental AG	629.834	1,91		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	32.627.927	99,06
15.919	Fresenius Medical Care AG & Company KGaA	1.320.959	4,01		Wert der Anlagen, insgesamt	32.627.927	99,06
40.915	Tele Columbus AG	358.825	1,09		(Gesamtkosten: EUR 30.100.756)		
	Summe Deutschland	4.912.109	14,91				
IRLAND							
15.161	Kingspan Group plc	521.538	1,58				
53.470	Ryanair Holdings plc	856.055	2,60				
9.763	Smurfit Kappa Group plc	321.398	0,98				
	Summe Irland	1.698.991	5,16				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
AUSTRALIEN				INDONESIEN			
26.439	Australia & New Zealand Banking Group Limited	544.722	1,03	3.565.600	Telekomunikasi Indonesia Tbk Pt	932.290	1,77
97.936	Bhp Billiton Limited	2.119.186	4,02		Summe Indonesien	932.290	1,77
116.352	Dexus Property Group	831.790	1,58				
14.415	Macquarie Group Limited	1.137.768	2,16		MACAU		
16.135	Rio Tinto Limited	899.761	1,71	419.200	Wynn Macau Limited	1.519.594	2,88
159.133	Sydney Airport Finance Company Pty Limited	819.043	1,55		Summe Macau	1.519.594	2,88
141.406	Transurban Group	1.238.676	2,35				
	Summe Australien	7.590.946	14,40		MALAYSIA		
				332.900	Malayan Banking Bhd	905.407	1,72
					Summe Malaysia	905.407	1,72
					PAKISTAN		
				267.200	Habib Bank Limited	481.913	0,91
					Summe Pakistan	481.913	0,91
					SÜDKOREA		
				20.727	ING Life Insurance Korea Limited	868.239	1,65
				23.824	KB Financial Group Inc.	1.376.820	2,62
				1.957	Samsung Electronics Company Limited Pfd	3.717.898	7,06
				5.571	SK Innovation Company Limited P.P. 144A	1.097.574	2,08
					Summe Südkorea	7.060.531	13,41
					SINGAPUR		
				81.100	DBS Group Holdings Limited	1.700.793	3,23
				75.600	United Overseas Bank Limited	1.585.450	3,01
					Summe Singapur	3.286.243	6,24
					TAIWAN		
				595.145	Advanced Semiconductor Engineering Inc.	860.353	1,63
				139.000	Chroma ATE Inc.	855.727	1,62
				770.000	King Yuan Electronics Company Limited	798.863	1,52
				112.000	MediaTek Inc.	1.271.458	2,41
				347.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	2.903.858	5,51
					Summe Taiwan	6.690.259	12,69
					INDIEN		
				55.092	Icici Bank Limited - ADR	487.564	0,93
				49.062	Infosys Technologies Limited - ADR	875.757	1,66
				44.147	Vedanta Limited	775.663	1,47
					Summe Indien	2.138.984	4,06

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
THAILAND			
1.088.000	Samui Airport Property Fund	807.226	1,53
2.076.900	Thai Wah pcl	816.957	1,55
	Summe Thailand	1.624.183	3,08
	Summe Aktien	49.989.478	94,88
Optionsscheine Aktien			
VEREINIGTE STAATEN			
814.490	JPMorgan BV on Baoshan Iron & Steel - Wts 30/04/2020 Str.0,01	1.119.850	2,13
	Summe Vereinigte Staaten	1.119.850	2,13
	Summe Optionsscheine Aktien	1.119.850	2,13
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	51.109.328	97,01
	Wert der Anlagen, insgesamt	51.109.328	97,01
(Gesamtkosten: USD 43.670.291)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Greater China Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Optionsscheine Aktien			
CHINA			
464	Kweichow Moutai Company Limited - Wts 14/07/2020 Str.0,01	50.881	1,34
	Summe China	50.881	1,34
LUXEMBURG			
9.311	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - Wts 28/10/2019 Str.0,01	41.458	1,08
5.696	JPMorgan BV on Hangzhou Hikvision - Wts 20/04/2020 Str.0,01	37.617	0,98
3.862	Wuliangye Yibin Company Limited - Wts 02/07/2020 Str.0,01	41.483	1,09
	Summe Luxemburg	120.558	3,15
VEREINIGTE STAATEN			
25.929	JPMorgan BV on Baoshan Iron & Steel - Wts 30/04/2020 Str.0,01	35.650	0,93
	Summe Vereinigte Staaten	35.650	0,93
	Summe Optionsscheine Aktien	207.089	5,42
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	3.789.872	99,15
	Wert der Anlagen, insgesamt	3.789.872	99,15
(Gesamtkosten: USD 2.624.242)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BERMUDAS				VEREINIGTE STAATEN			
177.800	Marvell Technology Group Limited	3.733.800	1,83	4.200	Adobe Systems Inc.	907.536	0,44
	Summe Bermudas	3.733.800	1,83	2.400	Advanced Energy Industries Inc.	153.360	0,08
KAIMANINSELN				4.300	Alphabet Inc. - A	4.459.702	2,18
5.400	Alibaba Group Holding Limited	991.116	0,48	4.702	Alphabet Inc. - C	4.851.477	2,38
20.200	JD.com Inc. - ADR	817.898	0,40	59.204	Apple Inc.	9.933.247	4,85
95.532	Pagseguro Digital Limited	3.660.786	1,79	130.700	Applied Materials Inc.	7.268.227	3,56
43.812	Secoo Holding Limited	459.588	0,22	43.108	Cavium Inc.	3.421.913	1,67
	Summe Kaimaninseln	5.929.388	2,89	12.200	Cisco Systems Inc.	523.258	0,26
CHINA				22.300	Cornerstone Ondemand Inc.	872.153	0,43
13.500	Ctrip.com International Limited - ADR	629.370	0,31	93.111	Cypress Semiconductor Corp.	1.579.163	0,77
	Summe China	629.370	0,31	19.746	Dxc Technology Company	1.985.065	0,97
ISRAEL				110.700	Ebay Inc.	4.454.568	2,18
57.228	Orbotech Limited	3.558.437	1,74	116.516	Electronics for Imaging Inc.	3.184.382	1,56
	Summe Israel	3.558.437	1,74	15.795	Euronet Worldwide Inc.	1.246.541	0,61
SÜDKOREA				21.700	Facebook Inc. - A	3.467.443	1,70
4.744	Hugel Inc.	2.652.604	1,30	8.300	Fidelity National Information Services Inc.	799.290	0,39
22.317	SK hynix Inc.	1.681.252	0,82	58.755	Fortinet Inc.	3.148.093	1,54
	Summe Südkorea	4.333.856	2,12	17.000	Godaddy Inc.	1.044.140	0,51
SINGAPUR				84.717	Inphi Corp.	2.549.982	1,25
49.480	Broadcom Limited	11.659.962	5,70	143.836	Integrated Device Technology Inc.	4.395.628	2,15
	Summe Singapur	11.659.962	5,70	84.761	Lam Research Corp.	17.220.044	8,41
VEREINIGTES KÖNIGREICH				343.601	Lattice Semiconductor Corp.	1.913.858	0,94
124.299	Arris International plc	3.302.625	1,61	16.199	Logmein Inc.	1.871.794	0,92
	Summe Vereinigtes Königreich	3.302.625	1,61	1.700	Lumentum Holdings Lite US	108.460	0,05
				48.145	Maxim Integrated Products Inc.	2.899.292	1,42
				60.200	Microchip Technology Inc.	5.499.872	2,69
				284.300	Micron Technology Inc.	14.823.402	7,25
				28.100	Microsoft Corp.	2.564.687	1,25
				17.200	Network Appliance	1.061.068	0,52
				398.594	Nuance Communications Inc.	6.277.856	3,08
				6.598	Okta Inc.	262.930	0,13
				91.512	On Semiconductor Corp.	2.238.384	1,10
				112.900	Oracle Corp.	5.165.175	2,53
				73.607	Qorvo Inc.	5.185.613	2,54
				21.002	Sailpoint Technologies Holding Inc.	434.531	0,21
				21.272	Salesforce.com Inc.	2.473.934	1,21
				10.100	Splunk Inc.	993.739	0,49
				100.849	Synaptics Inc.	4.611.825	2,26
				82.790	Synopsys Inc.	6.891.440	3,37
				119.954	Teradyne Inc.	5.483.097	2,68
				169.696	Tivo Corp.	2.299.381	1,13

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
29.800	Verint Systems Inc.	1.269.480	0,62
41.900	Visa Inc. - A	5.012.078	2,45
76.600	Western Digital Corp.	7.067.882	3,46
181.325	Xerox Corp.	5.218.534	2,55
4.988	Zscaler Inc.	140.013	0,07
	Summe Vereinigte Staaten	169.233.537	82,81
	Summe Aktien	202.380.975	99,01
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	202.380.975	99,01
	Wert der Anlagen, insgesamt	202.380.975	99,01
(Gesamtkosten: USD 173.144.099)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Mondrian Investment Partners - Emerging Markets Equity

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BERMUDAS				INDIEN			
11.105	Credicorp Limited	2.521.279	1,26	76.886	Bajaj Auto Limited	3.235.497	1,62
	Summe Bermudas	2.521.279	1,26	256.139	Hcl Technologies Limited	3.803.811	1,91
				89.821	Housing Development Finance Corp.	2.514.099	1,26
BRASILIEN				230.681	Indiabulls Housing Finance	4.375.907	2,19
279.730	Cielo SA	1.741.371	0,87	61.591	Infosys Technologies Limited	1.068.774	0,54
783.095	Companhia de Concessionarios Rodoviaris	2.945.210	1,47	35.140	Infosys Technologies Limited - ADR	627.249	0,31
261.630	Embraer SA - ADR	6.802.380	3,41	98.191	Larsen & Toubro Limited	1.973.513	0,99
177.300	Hypermarcas SA	1.928.986	0,97	236.578	Lupin Limited	2.669.085	1,33
815.800	Investimentos Itau SA Pfd	3.384.853	1,69	665.886	Power Grid Corp. of India Limited	1.972.960	0,99
205.418	Itau Unibanco Holding SA - ADR	3.204.522	1,61	15.983	Reliance Industries Limited	216.307	0,11
623.600	Kroton Educacional SA	2.551.743	1,28	656.374	Vedanta Limited	2.796.151	1,40
495.300	Suzano Papel e Celulose SA	4.971.486	2,49	4.004.072	Vedanta Limited 28/10/2018	610.835	0,31
	Summe Brasilien	27.530.551	13,79		Summe Indien	25.864.188	12,96
KAIMANINSELN				INDONESIEN			
506.000	China Medical System Holdings Limited	1.148.900	0,58	10.922.500	Bank Rakyat Indonesia	2.855.884	1,43
2.415.250	China State Construction International Holdings Limited	2.948.164	1,48		Summe Indonesien	2.855.884	1,43
200.000	Golden Eagle Retail Group Limited	229.094	0,11	MALAYSIA			
338.800	Sands China Limited	1.821.712	0,91	2.169.100	Ambb Holdings Bhd	2.175.833	1,09
4.019.500	WH Group Limited	4.281.562	2,14	2.718.300	Genting Malaysia Bhd	3.408.423	1,72
	Summe Kaimaninseln	10.429.432	5,22	795.600	Malayan Banking Bhd	2.163.838	1,08
				451.200	Tenaga Nasional Bhd	1.885.058	0,94
					Summe Malaysia	9.633.152	4,83
CHINA				MEXIKO			
8.095.000	China Construction Bank Corp.	8.313.347	4,18	2.623.589	Fibra Uno Administracion SA de CV	3.932.472	1,97
3.012.000	Dongfeng Motor Group Company Limited	3.496.208	1,75		Summe Mexiko	3.932.472	1,97
1.208.000	Jiangsu Expressway Company Limited - H	1.708.496	0,86	PHILIPPINEN			
642.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	6.532.809	3,27	62.168	Pldt Inc.	1.763.706	0,88
	Summe China	20.050.860	10,06		Summe Philippinen	1.763.706	0,88
HONGKONG				KATAR			
623.500	China Mobile Limited	5.715.987	2,87	33.190	Qatar Electricity & Water Company	1.713.265	0,86
1.923.499	China Resources Power Holdings Company Limited	3.509.611	1,76	41.050	Qatar National Bank SAQ P.P. 144A	1.465.264	0,73
7.890.000	Tongda Group Holdings Limited	1.507.968	0,76		Summe Katar	3.178.529	1,59
	Summe Hongkong	10.733.566	5,39				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Mondrian Investment Partners - Emerging Markets Equity

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
SÜDKOREA				TÜRKEI			
57.109	Kangwon Land Inc.	1.459.999	0,73	687.150	Turkiye Garanti Bankasi AS	1.890.729	0,95
75.412	Korea Electric Power Corp.	2.327.651	1,17	1.146.945	Turkiye Halk Bankasi	2.620.248	1,31
6.715	Korea Zinc Company Limited	3.036.509	1,52		Summe Türkei	4.510.977	2,26
3.794	Samsung Electronics Company Limited	8.727.691	4,37				
20.598	Samsung Sdi Company Limited	3.690.965	1,85		VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE		
97.791	Shinhan Financial Group Company Limited	4.142.268	2,08	3.207.232	Emaar Malls Group PJSC	1.877.361	0,94
15.428	SK Telecom Company Limited	3.329.040	1,67	842.472	First Abu Dhabi Bank PJSC	2.683.616	1,35
	Summe Südkorea	26.714.123	13,39		Summe Vereinigte Arabische Emirate	4.560.977	2,29
					Summe Aktien	194.470.188	97,47
RUSSISCHE FÖDERATION				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind			
1.274.310	Gazprom OAO - ADR	6.200.793	3,12			194.470.188	97,47
27.357	Lukoil PJSC - ADR	1.884.897	0,94				
128.146	MMC Norilsk Nickel PJSC - ADR	2.375.186	1,19				
	Summe Russische Föderation	10.460.876	5,25				
SÜDAFRIKA				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt			
69.424	Sasol Limited	2.362.596	1,18				
703.766	Woolworths Holdings Limited	3.563.744	1,79				
	Summe Südafrika	5.926.340	2,97				
TAIWAN				Aktien			
216.000	Asustek Computer Inc.	2.011.313	1,01				
2.860.640	CTBC Financial Holding Company Limited	2.050.528	1,03				
2.866.383	Mega Financial Holding Company Limited	2.462.624	1,23				
426.000	Novatek Microelectronics Corp. Limited	1.928.589	0,97				
598.000	Quanta Computer Inc.	1.205.965	0,60				
332.000	Taiwan Mobile Company Limited	1.241.140	0,62				
930.214	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	7.784.466	3,90				
	Summe Taiwan	18.684.625	9,36				
THAILAND				BRASILIEN			
470.300	Kasikornbank pcl - NVDR	3.188.522	1,60	19.172	Itausa	34.553	0,02
3.227.500	Thai Union Group	1.930.129	0,97		Summe Brasilien	34.553	0,02
	Summe Thailand	5.118.651	2,57		Summe Aktien	34.553	0,02
					Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt	34.553	0,02
					Wert der Anlagen, insgesamt	194.504.741	97,49
					(Gesamtkosten: USD 178.628.218)		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - STANLIB Global Emerging Markets Property Securities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BRASILIEN				MEXIKO			
18.915	BR Malls Participacoes SA	66.302	1,06	51.516	Corporacion Inmobiliaria Vesta SAB de CV	76.173	1,22
15.450	Iguatemi Empresa de Shopping Centers SA	182.503	2,92	66.013	Fibra Uno Administracion SA de CV	98.946	1,58
5.463	Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA	112.889	1,80	54.585	Prologis Property Mexico SA de CV	103.947	1,66
	Summe Brasilien	361.694	5,78	96.709	TF Administradora Industrial S de RL de CV	160.216	2,55
KAIMANINSELN				Summe Mexiko			
165.882	China Resources Land Limited	603.433	9,66			439.282	7,01
205.126	KWG Property Holding Limited	279.659	4,47	PHILIPPINEN			
117.560	Longfor Properties Company Limited	359.497	5,75	231.289	Ayala Land Inc.	182.182	2,91
98.983	Shimao Property Holdings Limited	279.987	4,48	1.826.852	Filinvest Land Inc.	57.769	0,92
	Summe Kaimaninseln	1.522.576	24,36	458.007	Sm Prime Holdings Inc.	295.809	4,73
CHINA				Summe Philippinen			
100.091	Beijing Capital International Airport Company Limited - H	134.419	2,15			535.760	8,56
99.584	China Vanke Company Limited - H	454.252	7,27	POLEN			
	Summe China	588.671	9,42	29.861	Globe Trade Centre	79.680	1,27
HONGKONG				Summe Polen			
211.057	China Jinmao Holdings Group Limited	120.207	1,92			79.680	1,27
167.990	China Overseas Land & Investment Limited	583.276	9,32	SINGAPUR			
	Summe Hongkong	703.483	11,24	245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
INDONESIEN				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
918.927	Bumi Serpong Damai Pt	118.800	1,90	104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
4.202.236	Pakuwon Jati Tbk Pt	192.281	3,08	358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
	Summe Indonesien	311.081	4,98	Summe Singapur			
ISLE OF MAN				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
26.562	Nepi Rockcastle plc	257.802	4,12	47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
	Summe Isle of Man	257.802	4,12	104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
MALAYSIA				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
139.681	Capitamalls Malaysia Trust	38.640	0,62	Summe Singapur			
67	Mah Sing Group Bhd	17	0,00	245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
	Summe Malaysia	38.657	0,62	47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.680	Ascendas India Trust	189.230	3,02
				47.045	Capitaretail China Trust	56.685	0,91
				104.332	First Real Estate Investment Trust	109.798	1,76
				358.118	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	105.144	1,68
				Summe Singapur			
				245.68			

Threadneedle (Lux) - STANLIB Global Emerging Markets Property Securities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE			
71.873	Emaar Malls Group PJSC	42.071	0,67
60.802	Emaar Properties PJSC	96.012	1,53
	Summe Vereinigte Arabische Emirate	138.083	2,20
	Summe Aktien	6.243.132	99,80
Optionsscheine Aktien			
THAILAND			
30.325	Supalai Public Company Limited - Wts 19/10/2018 Str.4	17.164	0,27
	Summe Thailand	17.164	0,27
	Summe Optionsscheine Aktien	17.164	0,27
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	6.260.296	100,07
	Wert der Anlagen, insgesamt	6.260.296	100,07
(Gesamtkosten: USD 5.718.054)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)	
Aktien				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	
KAIMANINSELN				95.885.299	43,05
78.774	Pagseguro Digital Limited	3.018.620	1,36	Wert der Anlagen, insgesamt	95.885.299
	Summe Kaimaninseln	3.018.620	1,36		
SINGAPUR				(Gesamtkosten: USD 79.344.454)	
21.959	Broadcom Limited	5.174.638	2,32		
	Summe Singapur	5.174.638	2,32		
VEREINIGTE STAATEN					
8.627	Adobe Systems Inc.	1.864.122	0,84		
29.700	Alexion Pharmaceuticals Inc.	3.310.363	1,48		
5.912	Alphabet Inc. - A	6.131.571	2,76		
1.990	Amazon.com Inc.	2.880.206	1,30		
26.243	Analog Devices Inc.	2.391.525	1,07		
1.392	Apple Inc.	233.550	0,10		
198.745	Bank of America Corp.	5.960.363	2,68		
32.134	Berkshire Hathaway Inc.	6.410.090	2,88		
32.549	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	2.638.747	1,18		
4.608	Boeing Company	1.510.871	0,67		
235	Booking Holdings Inc.	488.892	0,22		
26.120	Celgene Corp.	2.330.165	1,05		
9.608	Charter Communications Inc. - A	2.990.202	1,34		
10.944	Cigna Corp.	1.835.747	0,82		
39.082	DowDupont Inc.	2.489.914	1,12		
47.276	Dropbox Inc. - A	1.477.375	0,66		
7.863	Edwards Lifesciences Corp.	1.097.046	0,49		
15.030	Express Scripts Inc.	1.038.272	0,47		
13.637	Gilead Sciences Inc.	1.028.093	0,46		
29.351	JPMorgan Chase & Company	3.227.729	1,45		
4.339	L3 Technologies Inc.	902.512	0,41		
24.687	Lam Research Corp.	5.015.411	2,25		
3.863	Lockheed Martin Corp.	1.305.424	0,59		
95.265	Macom Technology Solutions	1.581.399	0,71		
13.042	Mastercard Inc. - A	2.284.437	1,03		
50.324	Microsoft Corp.	4.593.071	2,06		
23.912	Norfolk Southern Corp.	3.246.771	1,46		
18.024	Nutanix Inc. - A	885.159	0,40		
8.318	Paypal Holdings Inc.	631.087	0,28		
30.162	Phillips 66	2.893.139	1,30		
20.827	Tesaro Inc.	1.190.055	0,53		
15.524	UnitedHealth Group Inc.	3.322.136	1,50		
13.510	Vertex Pharmaceuticals Inc.	2.201.860	0,99		
41.140	Visa Inc. - A	4.921.166	2,20		
93.611	WPX Energy Inc.	1.383.571	0,62		
	Summe Vereinigte Staaten	87.692.041	39,37		
	Summe Aktien	95.885.299	43,05		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens			
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt (Fortsetzung)						
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				Commercial Paper und sonstige kurzfristige Instrumente (Fortsetzung)						
SUPRANATIONAL				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						
USD	1.000.000	IADB Discount Note 0.00% 11/07/2018	995.056	2,79	USD	1.000.000	Prudential Funding CP 0.00% 03/05/2018	998.425	2,80	
USD	1.000.000	IBRD Discount Note 0.00% 07/05/2018	998.244	2,80	USD	1.000.000	Roche Holdings Inc. 0.00% 23/04/2018	998.882	2,81	
		Summe Supranational	1.993.300	5,59	USD	1.000.000	Royal Bank of Canada 0.00% 14/05/2018	997.674	2,80	
VEREINIGTE STAATEN				Summe Vereingte Staaten						
USD	8.000.000	Federal Farm Credit System Discount Notes 0.00% 02/04/2018	7.999.644	22,47	USD	1.000.000	Sanofi 0.00% 05/06/2018	996.128	2,80	
		Summe Vereingte Staaten	7.999.644	22,47	USD	1.000.000	Shell International 0.00% 11/04/2018	999.422	2,81	
Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				9.992.944	28,06	USD	1.000.000	Toronto-Dominion Bank 2.27% 20/06/2018	1.000.253	2,80
Commercial Paper und sonstige kurzfristige Instrumente				Summe Vereingte Staaten						
KANADA				Summe Vereingte Staaten						
USD	1.000.000	Bank of Montreal 1.85% 14/05/2018	999.946	2,81	19.966.545					
		Summe Kanada	999.946	2,81	56,07					
VEREINIGTE STAATEN				Summe Commercial Paper und sonstige kurzfristige Instrumente						
USD	1.000.000	3M Company 0.00% 25/04/2018	998.725	2,80	20.966.491					
USD	1.000.000	ANZ New Zealand 0.00% 23/05/2018	997.326	2,80	58,88					
USD	1.000.000	Apple Inc. 0.00% 07/05/2018	998.256	2,80	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt					
USD	1.000.000	Bank of New York 0.00% 22/05/2018	997.270	2,80	30.959.435					
USD	1.000.000	Bank of Nova Scotia 0.00% 02/04/2018	999.806	2,81	86,94					
USD	1.000.000	Canadian Imperial Holding 0.00% 05/04/2018	999.708	2,81	Wert der Anlagen, insgesamt					
USD	1.000.000	Chevron Corp. 0.00% 15/06/2018	995.927	2,80	30.959.435					
USD	1.000.000	Exxon Mobil Corp. 0.00% 06/06/2018	996.416	2,80	86,94					
USD	1.000.000	GE Capital European 0.00% 11/04/2018	999.436	2,81	(Gesamtkosten: USD 30.923.940)					
USD	1.000.000	MetLife Short Term Funding LLC 0.00% 09/04/2018	999.505	2,81						
USD	1.000.000	New York Life Capital 0.00% 15/05/2018	997.585	2,80						
USD	1.000.000	Novartis Finance Corp. 0.00% 24/04/2018	998.722	2,80						
USD	1.000.000	Procter & Gamble 0.00% 15/05/2018	997.611	2,80						

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities*

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				
Anleihen				
LUXEMBURG				
EUR	100.000	Bevco Lux Sarl 1.75% 09/02/2023	99.948	2,48
EUR	100.000	Grand City Properties SA 1.50% 17/04/2025	100.344	2,49
EUR	100.000	Selp Finance Sarl 1.25% 25/10/2023	100.090	2,48
		Summe Luxemburg	300.382	7,45
NIEDERLANDE				
GBP	35.000	Innogy Finance BV 6.25% 03/06/2030	53.025	1,32
		Summe Niederlande	53.025	1,32
SCHWEDEN				
EUR	100.000	Akelius Residential 1.13% 14/03/2024	97.651	2,42
		Summe Schweden	97.651	2,42
VEREINIGTES KÖNIGREICH				
GBP	100.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	126.007	3,13
GBP	30.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	43.031	1,07
GBP	50.000	Legal & General Group plc FRN 23/07/2041	70.640	1,75
GBP	44.887	Tesco Property Finance 7.62% 13/07/2039	68.718	1,71
		Summe Vereinigtes Königreich	308.396	7,66
VEREINIGTE STAATEN				
USD	100.000	BAT Capital Corp. 3.22% 15/08/2024	78.440	1,95
USD	75.000	Becton Dickinson and Company FRN 06/06/2022	60.995	1,51
USD	75.000	Digital Realty Trust 2.75% 01/02/2023	58.655	1,46
USD	100.000	Kinder Morgan Inc. 4.30% 01/06/2025	81.922	2,03
		Summe Vereinigte Staaten	280.012	6,95
		Summe Anleihen	1.039.466	25,80
		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	1.039.466	25,80
		Wert der Anlagen, insgesamt	1.039.466	25,80
		(Gesamtkosten: EUR 1.038.721)		

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)					
Anleihen				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					
MEXIKO				VEREINIGTE STAATEN					
USD	83.000	Petroleos Mexicanos 6.50% 13/03/2027	88.769	0,80	USD	2.230.000	United States Treasury N/B 0.88% 15/07/2018	2.224.075	20,15
		Summe Mexiko	88.769	0,80	USD	2.180.000	United States Treasury N/B 1.00% 31/05/2018	2.177.445	19,74
NIEDERLANDE				Summe Vereinigte Staaten					
USD	65.000	Petrobras Global Finance BV 7.38% 17/01/2027	70.468	0,64				4.401.520	39,89
		Summe Niederlande	70.468	0,64	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
								8.119.008	73,60
Summe Anleihen									
			159.237	1,44	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				
								8.278.245	75,04
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt					
ARGENTINIEN				Anleihen					
USD	150.000	Argentina (Govt of) 7.50% 22/04/2026	160.600	1,46	PORTUGAL				
		Summe Argentinien	160.600	1,46	EUR	200.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2019	73.791	0,67
AUSTRALIEN				Summe Portugal					
AUD	1.400.000	Australia (Govt of) 1.75% 21/11/2020	1.065.499	9,66				73.791	0,67
AUD	1.400.000	Australia (Govt of) 2.00% 21/12/2021	1.066.745	9,67	Summe Anleihen				
		Summe Australien	2.132.244	19,33				73.791	0,67
ÄGYPTEN				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente					
USD	200.000	Egypt (Govt of) 7.50% 31/01/2027	217.127	1,97	RUSSISCHE FÖDERATION				
		Summe Ägypten	217.127	1,97	RUB	108.603.000	Russia (Govt of) 7.50% 18/08/2021	1.951.673	17,69
HONDURAS				Summe Russische Föderation					
USD	200.000	Honduras (Govt of) 7.50% 15/03/2024	221.858	2,01				1.951.673	17,69
		Summe Honduras	221.858	2,01	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
								1.951.673	17,69
ELFENBEINKÜSTE				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt					
USD	225.000	Ivory Coast (Govt of) 5.38% 23/07/2024	220.572	2,00				2.025.464	18,36
		Summe Elfenbeinküste	220.572	2,00					
SÜDAFRIKA									
ZAR	9.322.255	South Africa (Govt of) 8.50% 31/01/2037	765.087	6,94					
		Summe Südafrika	765.087	6,94					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Fonds			
LUXEMBURG			
57	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond Portfolio - AU	1.852	0,02
	Summe Luxemburg	1.852	0,02
	Summe Fonds	1.852	0,02
	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	1.852	0,02
	Wert der Anlagen, insgesamt	10.305.561	93,42
(Gesamtkosten: USD 10.216.637)			

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
VEREINIGTE STAATEN				
USD	75.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 16/08/2018	74.460.375	13,51
USD	75.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 11/10/2018	74.238.690	13,47
USD	75.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 08/11/2018	74.124.495	13,44
USD	75.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 06/12/2018	74.007.713	13,42
		Summe Vereinigte Staaten	296.831.273	53,84
		Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente	296.831.273	53,84
		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	296.831.273	53,84
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
VEREINIGTE STAATEN				
USD	75.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 21/06/2018	74.705.204	13,55
USD	75.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 19/07/2018	74.589.833	13,53
USD	75.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 13/09/2018	74.344.455	13,48
		Summe Vereinigte Staaten	223.639.492	40,56
		Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente	223.639.492	40,56
		Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt	223.639.492	40,56
		Wert der Anlagen, insgesamt	520.470.765	94,40
(Gesamtkosten: USD 519.750.683)				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity*

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 31. März 2018

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung				Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
AUSTRALIEN				NIEDERLANDE			
798	CSL Limited	95.158	0,83	1.313	ASML Holding NV	258.609	2,25
	Summe Australien	95.158	0,83		Summe Niederlande	258.609	2,25
KANADA				SINGAPUR			
8.100	Suncor Energy Inc.	279.519	2,42	654	Broadcom Limited	154.115	1,34
	Summe Kanada	279.519	2,42		Summe Singapur	154.115	1,34
KAIMANINSELN				SPANIEN			
756	Netease.com - ADR	211.975	1,84	6.503	Inditex SA	203.382	1,77
	Summe Kaimaninseln	211.975	1,84		Summe Spanien	203.382	1,77
FRANKREICH				SCHWEDEN			
1.396	Essilor International SA	188.169	1,63	5.978	Atlas Companynco AB - B	257.828	2,24
1.733	L'Oreal SA	390.780	3,39		Summe Schweden	257.828	2,24
3.342	Schneider Electric SE	293.219	2,55		SCHWEIZ		
	Summe Frankreich	872.168	7,57	2.620	Novartis AG - Reg	211.384	1,83
DEUTSCHLAND				965	Roche Holding AG	220.793	1,92
2.710	BASF SE	274.864	2,39	2.641	Tyco Electronics Limited	263.836	2,29
	Summe Deutschland	274.864	2,39		Summe Schweiz	696.013	6,04
IRLAND				VEREINIGTES KÖNIGREICH			
876	DCC plc	80.613	0,70	6.214	Rio Tinto plc	314.771	2,73
813	Ryanair Limited	99.877	0,87	6.788	Unilever plc	376.651	3,27
	Summe Irland	180.490	1,57		Summe Vereinigtes Königreich	691.422	6,00
JAPAN				VEREINIGTE STAATEN			
4.800	Bridgestone Corp.	208.880	1,81	2.733	Activision Blizzard Inc.	184.368	1,60
9.600	Capcom Company Limited	218.719	1,90	279	Alphabet Inc. - A	289.362	2,51
4.300	Hoya Corp.	214.656	1,86	2.449	Applied Materials Inc.	136.189	1,18
200	Keyence Corp.	123.178	1,07	7.943	Boston Scientific Corp.	217.003	1,88
1.000	Nidec Corp.	151.387	1,31	5.658	Bristol-Myers Squibb Company	357.868	3,10
200	Nintendo Company Limited	87.748	0,76	754	Cooper Companies Inc.	172.523	1,50
7.900	Sekisui Chemical Company Limited	136.681	1,19	3.172	Dentsply Sirona Inc.	159.583	1,38
1.100	Tokyo Electron Limited	198.745	1,72	937	Diamondback Energy Inc.	118.549	1,03
	Summe Japan	1.339.994	11,62	2.620	Eog Resources Inc.	275.807	2,39
JERSEY - KANALINSELN				1.059	Estee Lauder Companies Inc.	158.553	1,38
1.258	Aptiv plc	106.892	0,93	1.399	Facebook Inc. - A	223.546	1,94
4.925	Ferguson plc	369.897	3,21	2.976	Gilead Sciences Inc.	224.361	1,95
	Summe Jersey - Kanalinseln	476.789	4,14	5.818	Halliburton Company	273.097	2,37
				882	Illumina Inc.	208.522	1,81
				2.648	Microsoft Corp.	241.683	2,10
				771	Mohawk Industries Inc.	179.042	1,55

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity*

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
2.703	Nike Inc.	179.587	1,56
3.196	Occidental Petroleum Corp.	207.612	1,80
1.183	PepsiCo Inc.	129.124	1,12
4.437	Pfizer Inc.	157.469	1,37
1.840	Stryker Corp.	296.092	2,57
3.575	Tjx Companies Inc.	291.577	2,53
1.808	Union Pacific Corp.	243.050	2,11
1.396	United Parcel Service Inc.	146.105	1,27
2.277	Valero Energy Corp.	211.237	1,83
660	Vertex Pharmaceuticals Inc.	107.567	0,93
	Summe Vereinigte Staaten	5.389.476	46,76
	Summe Aktien	11.381.802	98,78
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	11.381.802	98,78
	Wert der Anlagen, insgesamt	11.381.802	98,78
(Gesamtkosten: USD 10.945.876)			

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

1 ALLGEMEINES

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

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

Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres:

Neue Verkaufsprospekte

Im Mai 2017, Juli 2017, Dezember 2017 und März 2018 wurden neue Verkaufsprospekte veröffentlicht.

Änderungen der Anlagepolitik der Portfolios und Namensänderungen

Während des Berichtszeitraums gab es keine Änderungen an der jeweiligen Anlagepolitik der Portfolios oder Namensänderungen.

Auflegung und Schließung von Portfolios

Das Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity Portfolio wurde am 26. April 2017 aufgelegt.

Das Threadneedle (Lux) - European Social Bond Portfolio wurde am 24. Mai 2017 aufgelegt.

Das Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities wurde am 16. Juni 2017 aufgelegt.

Das Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Portfolio wurde am 28. März 2018 aufgelegt.

Mit Wirkung zum 17. Januar 2018 wurde für das Threadneedle (Lux) - Global Energy Equities Portfolio ein Liquidationsverfahren eingeleitet.

Auflegung und Schließung von Anteilklassen

Im Berichtszeitraum zum 31. März 2018 wurden folgende Anteilklassen aufgelegt:

Anteilklasse	Portfolio	Auflegungsdatum
DEC	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	26. April 2017
DUP	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	26. April 2017
NEH	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	29. Januar 2018
NGC	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	29. Januar 2018
NGH	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	29. Januar 2018
NU	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	29. Januar 2018
ZEH	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	26. April 2017
IE	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	24. Mai 2017
IEP	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	24. Mai 2017
IFH	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	15. Juni 2017
LE	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	24. Mai 2017
ZE	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	24. Mai 2017
ZFH	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	15. Juni 2017
BU	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	7. November 2017
BUP	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	7. November 2017
BU	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	7. November 2017
BUP	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	7. November 2017
BU	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	7. November 2017
BUP	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	7. November 2017
IEC	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	13. Juli 2017
ZFH	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	13. Juli 2017
AS	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	13. Juli 2017
AVC	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	13. Juli 2017
AVH	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	13. Juli 2017
BU	Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	7. November 2017
AE	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	13. Juli 2017
DEH	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	26. April 2017
ZE	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	13. Juli 2017
ZEH	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	26. April 2017
ZU	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	26. April 2017
BU	Threadneedle (Lux) - Global Focus	7. November 2017
IE	Threadneedle (Lux) - Global Focus	26. April 2017
IU	Threadneedle (Lux) - Global Focus	26. April 2017
BU	Threadneedle (Lux) - American	7. November 2017
AS	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	13. Juli 2017
AS	Threadneedle (Lux) - Asian Focus	13. Juli 2017

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

1 ALLGEMEINES

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Portfolio	Auflegungsdatum
ASP	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	13. Juli 2017
AE	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	16. Juni 2017
AEH	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	16. Juni 2017
AU	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	16. Juni 2017
AUP	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	16. Juni 2017
DE	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	16. Juni 2017
DEH	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	16. Juni 2017
DU	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	16. Juni 2017
IE	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	16. Juni 2017
IEC	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	16. Juni 2017
IEH	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	16. Juni 2017
IFH	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	16. Juni 2017
IU	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	16. Juni 2017
ZEH	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	16. Juni 2017
ZFH	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	16. Juni 2017
ZU	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	16. Juni 2017
BUH	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	7. November 2017
ZG	Threadneedle (Lux) - European Select	26. April 2017
AUP	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	26. April 2017
DUP	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	26. April 2017
IEP	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	26. April 2017
AS	Threadneedle (Lux) - Global Technology	13. Juli 2017
IEH	Threadneedle (Lux) - Global Technology	21. Juni 2017
ZFH	Threadneedle (Lux) - Global Technology	13. Juli 2017
AFH	Threadneedle (Lux) - UK Equities	26. April 2017
DEH	Threadneedle (Lux) - UK Equities	13. Juli 2017
DG	Threadneedle (Lux) - UK Equities	13. Juli 2017
IUH	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	26. April 2017
XGH	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	26. April 2017
AE	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
AFH	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
AUH	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
DE	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
IE	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
IEP	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
IGH	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
IUH	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
JE	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
JGH	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
JUH	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
LE	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
LEP	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
LGH	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
YE	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
YGH	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
YUH	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
ZE	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
ZFH	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
ZGH	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
ZUH	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	28. März 2018
ZF	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	26. April 2017
AU	Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity	26. April 2017
XU	Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity	26. April 2017

Die folgenden Anteilklassen wurden im Geschäftsjahr zum 31. März 2018 inaktiv:

Anteilklasse	Portfolio	Auflegungsdatum
P	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	21. Juni 2017
ZEC	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	18. Januar 2018
ASH	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	25. August 2017
IFH	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	22. März 2018
IFH	Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	31. Mai 2017
XGH	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	21. September 2017

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

1 ALLGEMEINES

(Fortsetzung)

Zum 31. März 2018 lauteten die aktiven Portfolios der SICAV wie folgt:

Die Anleiheportfolios:

- Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond¹
- Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) - European Social Bond
- Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond¹
- Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds¹
- Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt¹
- Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds¹
- Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond¹
- Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Die Asset Allocation Portfolios:

- Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation¹
- Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Die Aktienportfolios:

- Threadneedle (Lux) - Global Focus¹
- Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities¹
- Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - American¹
- Threadneedle (Lux) - American Select¹
- Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity¹
- Threadneedle (Lux) - Asian Focus¹
- Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income¹
- Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities
- Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities
- Threadneedle (Lux) - Pan European Equities¹
- Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities¹
- Threadneedle (Lux) - European Select
- Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income¹
- Threadneedle (Lux) - Greater China Equities¹
- Threadneedle (Lux) - Global Technology¹
- Threadneedle (Lux) - Mondrian Investment Partners - Emerging Markets Equity
- Threadneedle (Lux) - UK Equities
- Threadneedle (Lux) - UK Equity Income
- Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity
- Threadneedle (Lux) - STANLIB Global Emerging Markets Property Securities

Die Absolute-Return-Portfolios:

- Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha
- Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia
- Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond
- Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

Das Specialist Portfolio:

- Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities¹

The Shariah Portfolio:

- Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity

¹Diese Portfolios wurden zum 31. März 2018 von der Securities and Futures Commission in Hongkong zugelassen und sind in Hongkong für die Öffentlichkeit verfügbar.

2 ZUSAMMENFASSUNG DER WESENTLICHEN RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE

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

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

2 ZUSAMMENFASSUNG DER WESENTLICHEN RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE

(Fortsetzung)

Der Abschluss wird auf der Grundlage der Nettoinventarwerte der Portfolios erstellt, die zum 29. März 2018 berechnet werden. Der letzte offizielle Handelsnettoinventarwert der entsprechenden Portfolios wurde zum 29. März 2018 berechnet.

I) *Bewertung der Wertpapiere*

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

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

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

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

Die Verwaltungsratsmitglieder der SICAV (die „Verwaltungsratsmitglieder“) können in eigenem Ermessen die Verwendung anderer Bewertungsmethoden genehmigen, wenn sie der Ansicht sind, dass sie den beizulegenden Zeitwert eines Vermögenswerts der SICAV besser wiedergeben.

II) *Devisenterminkontrakte*

Zur Absicherung besonderer Währungsrisiken bzw. zur Anlage in anderen Währungen darf die SICAV Devisenterminkontrakte eingehen. Zum Ende des Geschäftsjahres wurden die offenen Devisenterminkontrakte zu den Terminkursen bewertet, die für die Restlaufzeit bis Fälligkeit gültig waren. Die Nettobewegung der entstandenen nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus Devisenterminkontrakten ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens ausgewiesen. Die zum 31. März 2018 offenen Kontrakte sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

III) *Terminkontrakte*

Die SICAV kann Devisentermingeschäfte eingehen. Offene Terminkontrakte werden zu den Kursen an der Börse bewertet, an denen die Kontrakte gehandelt werden. Die Nettobewegung der entstandenen nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus Terminkontrakten ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens ausgewiesen. Die zum 31. März 2018 offenen Kontrakte sind in Erläuterung 11 aufgeführt.

IV) *Swap-Geschäfte*

Die SICAV darf Aktienswaps, Zinsswaps („IRS“), Kreditausfallswaps („CDS“) und Total Return Swaps („TRS“) abschließen. Zinsswaps (IRS) werden auf Basis ihres Marktwerts bewertet, der sich aus der gültigen Zinskurve ergibt. Kreditausfallswaps werden unter Bezug auf den aktuellen Nettowert des erwarteten zukünftigen Cashflows, basierend auf den marktüblichen Zinssätzen und der an dem Markt zu erwartenden Ausfall und Rückgewinnungsrate der zu Grunde liegenden Vermögenswerte, bewertet. Eine gegebenenfalls von der SICAV geleistete Vorauszahlung wird in der Aufstellung des Nettovermögens als Vermögenswert ausgewiesen. Eine gegebenenfalls von der SICAV erhaltene Vorauszahlung wird in der Aufstellung des Nettovermögens als Verpflichtung ausgewiesen. Zinsswaps werden auf Grundlage ihres Marktwerts bewertet, der sich aus der gültigen Zinskurve ergibt. Die Nettobewegung der entstandenen nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus Swap-Geschäften ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens ausgewiesen. Die zum 31. März 2018 offenen Kontrakte sind in Erläuterung 10 aufgeführt. Die ggf. auf Swap-Short-Positionen zahlbaren Dividenden werden in der Aufstellung des Nettovermögens als Verpflichtung ausgewiesen.

V) *Optionsgeschäfte*

An einem geregelten Markt gehandelte Optionen werden zum Marktpreis am Tag der Bewertung bewertet. Solche zum 31. März 2018 offenen Optionen sind dem Anlageverzeichnis zu entnehmen. Over the Counter („OTC“)-Optionen werden zu Preisen bewertet, die von externen Preisagenturen/Modellen bereitgestellt werden. Solche zum 31. März 2018 offenen Optionen sind in Erläuterung 12 aufgeführt. Zum Zeitpunkt der Berichterstellung durch die Bewertung von Optionsgeschäften entstandene nicht realisierte Gewinne oder Verluste werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens ausgewiesen.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

2 ZUSAMMENFASSUNG DER WESENTLICHEN RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE

(Fortsetzung)

VI) Währungsrechnung

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

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

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

Die konsolidierte Aufstellung des Nettovermögens sowie die konsolidierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und die Veränderungen des Nettovermögens werden in USD vorgelegt. Sie beruhen auf den Wechselkursen, die am Datum der Aufstellung des Nettovermögens gültig waren. Wechselkurse zum 31. März 2018: 1 USD = 1,303696 AUD, 1 USD = 0,813107 EUR, 1 USD = 0,712860 GBP, 1 USD = 0,957600 CHF, 1 USD = 8,374789 SEK und 1 USD = 1,311300 SGD.

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

VII) Bankguthaben

Das in der Aufstellung des Nettovermögens angegebene Bankguthaben beinhaltet auch die Margen auf Futures und von Makler zahlbare Barsicherheiten für Swapgeschäfte und Devisenterminkontrakte.

Bankguthaben und Margen auf Futures werden zu Anschaffungskosten bewertet, was in etwa dem Marktwert entspricht.

VIII) Termineinlagen

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

IX) Anlagetransaktionen und Anlageertrag

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

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

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

X) Ausschüttungspolitik

Die Politik der SICAV hinsichtlich aller Anteilklassen von Portfolios, mit Ausnahme der Klassen, deren Bezeichnungen auf „P“ oder „C“ enden, besteht darin, keine Ausschüttungen zu veranlassen, sondern alle Nettoerlöse im Portfolio zu behalten und diese innerhalb desselben Portfolios und derselben Klasse zu investieren. Hinsichtlich der Klassen, deren Bezeichnungen auf „P“ oder „C“ enden, zielt die SICAV darauf ab, mindestens einmal jährlich eine Ausschüttung zu veranlassen, wobei deren genaues Intervall und deren Höhe von den Verwaltungsratsmitgliedern bestimmt wird. Die Anteilinhaber dieser Anteilklassen können sich entweder für eine Ausschüttung oder eine Wiederanlage der Erträge in die SICAV entscheiden.

XI) Rückerstattungen der Vermögensverwaltungsgebühr

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

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

3 BESTEUERUNG

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

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

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

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

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

4 SONSTIGE GEBÜHREN

Die sonstigen Gebühren umfassen Devisengebühren, italienische Steuern, Entschädigungen für NIW-Fehler und Quellensteuern auf Erträge aus Derivaten. Beim Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity Portfolio bestehen die sonstigen Gebühren aus dem zu spendenden unreinen Ertrag.

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

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

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2018 ging die SICAV keine Transaktionen mit verbundenen Personen ein.

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

Weder die Verwaltungsgesellschaft noch TAML haben Kommissionen auf Brokertransaktionen erhalten.

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

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

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

Sämtliche durch den Betrieb der SICAV entstandenen und nachstehend definierten Kosten (nachstehend die „Betriebskosten“, „Vermögensverwaltungsgebühr“ oder „Portfoliogeühren“, zusammen die „Aufwendungen“) werden zu den in den Tabellen ab Seite 165 aufgeführten Sätzen festgelegt, mit Ausnahme der Anteilklasse M, für die die Betriebskosten 0,20 % pro Jahr betragen. Alle Aufwendungen fallen auf der Grundlage des Nettoinventarwertes der entsprechenden Anteilklasse im entsprechenden Portfolio täglich an.

Register und Transferstelle sowie der Zahlstelle, Aufwendungen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen, Registrierungsgebühren und Aufwendungen in verschiedenen Rechtsgebieten, Notierungsgebühren, Gebühren für nicht verbundene Verwaltungsratsmitglieder der SICAV, Aufwendungen

*Siehe Erläuterung 1.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

für die Verwaltungsratsmitglieder und Führungskräfte der SICAV und die Unterberater für deren Teilnahme an Sitzungen des Verwaltungsrates und Versammlungen der Anteilhaber der SICAV, Übersetzungskosten, Rechnungslegungs- und Kursermittlungskosten (einschließlich der Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil), Versicherung, Rechtsstreitigkeiten und sonstige außerordentliche oder nicht wiederkehrende Aufwendungen und alle sonstigen Aufwendungen, die durch die SICAV ordnungsgemäß zu entrichten sind. In den Betriebskosten ist auch die an die Verwaltungsgesellschaft zahlbare Servicegebühr enthalten. Die Depotbank und Unterdepotkosten werden nur bei der Anteilsklasse M durch die entsprechenden Anteilsklassen bei Entstehen entrichtet und sind nicht in den Betriebskosten enthalten. Die Verwaltungsgesellschaft trägt jegliche überschüssigen Betriebskosten über dem Jahressatz. Hingegen ist die Verwaltungsgesellschaft berechtigt, einen Betrag einzubehalten, um den der Jahressatz für Betriebskosten die der SICAV tatsächlich entstandenen Aufwendungen übersteigt.

Darüber hinaus hat die Verwaltungsgesellschaft Anspruch auf eine Vermögensverwaltungsgebühr (die „Vermögensverwaltungsgebühr“), die in den Tabellen ab Seite 165 näher beschrieben wird und die täglich anfällt und monatlich zahlbar ist. Für die X-Anteile wird keine Anlageverwaltungsgebühr fällig. Zur Klarstellung: Die Betriebskosten umfassen weder Anlageverwaltungsgebühren noch Performance-Gebühren, die hiervon unabhängig sind und gesondert erhoben werden.

Für die Anteilsklasse M können Transaktionskosten (für Zeichnungen, Rücknahmen oder Umschichtungen) von bis zu 0,75 % des Nettoinventarwerts anfallen, wobei eine faire und angemessene Behandlung der Anteilhaber sichergestellt sein muss. Für die Anteilsklasse M läuft täglich eine Vermögensverwaltungsgebühr von bis zu 0,95 % des gesamten Nettoinventarwertes der Anteilsklasse pro Jahr auf, die monatlich zahlbar ist.

Die SICAV kann B-Anteile in bestimmten Portfolios anbieten. Bei B-Anteilen fällt kein Ausgabeaufschlag an, jedoch wird eine fortlaufende Vertriebsgebühr von 1,00 % des gesamten Nettoinventarwertes der Klasse pro Jahr erhoben. Es wird eine bedingte gestaffelte Rücknahmegebühr („CDSC“) erhoben, wie auf Seite 173 beschrieben.

B-Anteile des Threadneedle (Lux) Global Technology sind eine veraltete Anteilsklasse, die nur von bestehenden Anteilhabern gezeichnet werden können. Für diese Anteilsklasse gilt keine bedingt aufgeschobene Verkaufsgebühr.

A-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag als Prozentsatz des angelegten Betrags	Umtauschgebühr
Bond Portfolios	Maximal 3,0 % ¹	maximal 0,75 %
Equity Portfolios und Asset Allocation Portfolios	maximal 5,0 %	maximal 0,75 %
Absolute Return Portfolios	maximal 5,0 %	maximal 0,75 %
Specialist Portfolio	maximal 5,0 %	maximal 0,75 %
Shariah Portfolio	maximal 5,0 %	maximal 0,75 %

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

Portfolio Typ	Name des Portfolios	Anlage-		Basiswährung
		verwaltungsgebühr	Betriebskosten	
Bond Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	0,90 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,60 % ²	0,25 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,90 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,35 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,35 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,30 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	0,90 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	1,25 %	0,30 %	USD
Asset Allocation Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	1,35 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	1,25 %	0,30 %	USD

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio Typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Equity Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,50 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,50 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	1,50 %	0,30 % ⁷	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,50 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,50 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	1,50 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus	1,50 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	1,50 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	1,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities*	0,55 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,50 %	0,30 % ⁷	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,50 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,50 %	0,30 % ⁷	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,50 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Greater China Equities	1,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Energy Equities*	1,65 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	1,65 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	1,50 %	0,30 % ⁷	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	1,50 %	0,30 % ⁷	GBP
Absolute Return Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	1,50 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	1,25 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities*	0,90 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	1,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha*	1,50 %	0,35 %	EUR
Specialist Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	1,75 %	0,30 % ⁷	USD
Shariah Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity*	1,50 %	0,35 %	USD

B-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	entfällt	Null
	Bedingte gestaffelte Rücknahmegebühr	

Portfolio Typ	Name des Portfolios	Vermögens- verwaltungsgebühr	Vertriebsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Bond Portfolios					
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,35 %	1,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,30 %	1,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,25 %	1,00 %	0,30 %	USD
Asset Allocation Portfolio					
	Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	1,35 %	1,00 %	0,35 %	USD

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio Typ	Name des Portfolios	Vermögens- verwaltungsgebühr	Vertriebsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Equity Portfolios					
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,50 %	1,00 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,50 %	1,00 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,50 %	1,00 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	2,00 %	Null	0,35 %	USD

D-ANTEILE:

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

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

Portfolio Typ	Name des Portfolios	Vermögens- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Bond Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	1,35 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	1,35 %	0,25 % ³	USD
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	1,45 %	0,25 % ⁸	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,45 % ⁹	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,45 % ⁹	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,45 % ¹⁰	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,45 % ¹¹	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	1,25 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	1,45 % ¹²	0,30 %	USD
Asset Allocation Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	2,00 % ¹¹	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	2,00 %	0,30 %	USD
Equity Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	2,25 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	2,25 % ¹³	0,30 % ⁷	USD
	-Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	2,00 %	0,30 % ⁷	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,85 % ⁹	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	2,25 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	2,25 % ¹³	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus	2,25 % ¹³	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	2,25 % ¹³	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	2,00 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities*	0,75 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,85 % ¹¹	0,30 % ⁷	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	2,40 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	2,25 % ¹³	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Greater China Equities	2,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Energy Equities*	2,25 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	2,00 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	2,25 %	0,35 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	2,25 %	0,30 % ⁷	GBP

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio Typ	Name des Portfolios	Vermögens- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Absolute Return Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	2,00 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	2,00 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities*	1,45 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	1,90 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha*	2,00 %	0,35 %	EUR
Specialist Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	2,25 %	0,30 % ⁷	USD

I-ANTEILE:

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

Portfolio Typ	Name des Portfolios	Vermögens- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Bond Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,50 %	0,15 % ⁴	USD
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond*	0,40 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,40 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,65 % ¹⁴	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,65 % ¹⁴	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,65 % ¹⁴	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,55 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	0,40 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,60 % ¹⁴	0,20 %	USD
Asset Allocation Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	0,75 %	0,20 %	USD
Equity Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75 % ¹⁴	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75 % ¹⁵	0,20 % ¹⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,70 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,80 %	0,20 % ¹⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75 % ¹⁵	0,20 % ¹⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus	0,75 % ¹⁵	0,20 % ¹⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	0,75 % ¹⁵	0,20 % ¹⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,80 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities*	0,25 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,75 % ¹⁴	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,85 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75 % ¹⁴	0,20 % ¹⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85 %	0,20 % ¹⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,65 %	0,20 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,65 %	0,20 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	1,25 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Global Emerging Markets Property Securities	1,25 %	0,35 %	USD

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio Typ	Name des Portfolios	Vermögens- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Absolute Return Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	0,65 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities*	0,35 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	0,55 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha*	0,75 %	0,20 %	EUR
Specialist Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,80 % ¹⁷	0,20 % ¹⁶	USD

J-ANTEILE:

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

Eine Performance-Gebühr wird auch für J-Anteile erhoben, wie im Abschnitt „Performance-Gebühr“ im Hauptteil des Prospekts beschrieben.

Portfolio Typ	Portfolio	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Absolute-Return-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities*	0,25 %	0,20 %	EUR

L-ANTEILE:

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

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

Portfolio Typ	Portfolio	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Rentenportfolio				
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond*	0,30 %	0,10 %	EUR
Aktienportfolio				
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,50 %	0,20 %	GBP
Absolute Return Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	0,35 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities*	0,20 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,375 %	0,20 %	EUR

N-ANTEILE:

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

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

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

Portfolio Typ	Portfolio	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Rentenportfolio				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,30 %	0,15 %	USD

S-ANTEILE:

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

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

Portfolio Typ	Portfolio	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Rentenportfolio				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,50 %	0,30 %	USD

T-ANTEILE:

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

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

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Rentenportfolio				
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,55 %	0,10 %	USD

W-ANTEILE (EINSCHLIESSLICH P-ANTEILE):

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

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

Portfolio Typ	Name des Portfolios	Vermögens-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Bond Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,85 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,15 %	0,30 %	USD

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio Typ	Name des Portfolios	Vermögens- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Asset Allocation Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	1,40 %	0,35 %	USD
Equity Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,40 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,15 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,40 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,40 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,55 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,65 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Greater China Equities	1,65 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Energy Equities*	1,40 %	0,35 %	USD

X-ANTEILE

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag als Prozentsatz des angelegten Betrags	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	entfällt	maximal 0,75 %

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Betriebskosten	Basiswährung
Bond Portfolios			
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,15 %	USD
Equity Portfolios			
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,15 %	EUR
Absolute Return Portfolios			
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,15 %	EUR
Specialist Portfolio			
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,15 %	USD
Shariah Portfolio			
	Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity*	0,25 %	USD

Y-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag als Prozentsatz des angelegten Betrags	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	5,00 %	maximal 0,75 %

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

Eine Performance-Gebühr wird auch für Y-Anteile erhoben, wie im Abschnitt „Performance-Gebühr“ im Hauptteil des Prospekts beschrieben.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-Typ	Portfolio	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Absolute-Return-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities*	0,35 %	0,25 %	EUR

Z-ANTEILE

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag als Prozentsatz des angelegten Betrags	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	5,00 %	maximal 0,75 %

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

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Vermögens-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Bond Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,40 % ⁵	0,20 % ⁶	USD
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond*	0,40 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,60 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,60 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,60 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	0,50 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,60 %	0,30 %	USD
Asset Allocation Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	0,75 %	0,30 %	USD
Equity Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75 %	0,30 % ⁷	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus	0,75 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	0,75 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,75 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities*	0,30 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85 %	0,30 % ⁷	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75 %	0,30 % ⁷	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75 %	0,30 % ⁷	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	1,25 %	0,35 %	USD
Absolute Return Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	0,75 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities*	0,45 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	0,55 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,75 %	0,30 %	EUR
Specialist Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,75 %	0,30 % ⁷	USD

*Siehe Erläuterung 1.

¹2,0 % bis zum 27. April 2017.²0,90 % bis 31. Mai 2017.³0,30 % bis 31. Mai 2017.⁴0,20 % bis 31. Mai 2017.⁵0,50 % bis 31. Mai 2017.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

⁶0,25 % bis 31. Mai 2017.

⁷0,35 % bis 31. Januar 2018.

⁸0,30 % bis 31. Januar 2018.

⁹2,00 % bis 31. Januar 2018.

¹⁰1,55 % bis 31. Januar 2018.

¹¹2,25 % bis 31. Januar 2018.

¹²1,75 % bis 31. Januar 2018.

¹³2,50 % bis 31. Januar 2018.

¹⁴0,80 % bis 31. Januar 2018.

¹⁵0,85 % bis 31. Januar 2018.

¹⁶0,25 % bis 31. Januar 2018.

¹⁷1,00 % bis 31. Januar 2018.

B-ANTEILE - BEDINGTE GESTAFFELTE RÜCKNAHMEGEBÜHR (CDSC)

Auf B-Anteile, die innerhalb von 2 Jahren nach dem Kauf zurückgenommen werden, wird eine bedingte gestaffelte Rücknahmegebühr erhoben, deren Höhe sich mit der Zeit verringert. Der erhobene Betrag in Prozent ist wie folgt:

Jahre seit dem Kauf	Bedingte gestaffelte Rücknahmegebühr
weniger als 1 Jahr	2 %
1 Jahr oder länger aber weniger als 2 Jahre	1 %

Die Höhe der bedingten gestaffelten Rücknahmegebühr entspricht dem aktuellen Nettoinventarwert der zurückzunehmenden B-Anteile, multipliziert mit dem entsprechenden oben genannten Prozentsatz.

Umtausch von B-Anteilen

B-Anteile können, sofern verfügbar, gegen B-Anteile in einem anderen Portfolio umgetauscht werden, ohne dass eine bedingte gestaffelte Rücknahmegebühr erhoben wird. Sie können jedoch nicht ohne diese Gebühr in andere Klassen umgetauscht werden. Das Alter der B-Anteile wird fortlaufend und ohne Berücksichtigung von Tauschvorgängen berechnet. Entsprechend wird bei der Rücknahme von Anteilen, die im Tausch gegen B-Anteile eines anderen Portfolios erworben wurden, die gegebenenfalls anfallende bedingte gestaffelte Rücknahmegebühr so erhoben, als seien die zurückgenommenen Anteile seit ihrem ursprünglichen Kaufdatum gehalten worden. Dividenden für B-Anteile können nicht wieder angelegt werden. Sie werden an die Anteilinhaber ausgezahlt.

Um die zahlbare bedingte gestaffelte Rücknahmegebühr so gering wie möglich zu halten, geht die SICAV bei jedem Anteilinhaber davon aus, dass zuerst die B-Anteile zurückgegeben werden, die in der Zweijahresfrist am längsten gehalten wurden.

Nach Ablauf der zweijährigen Frist ab dem Kauf werden B-Anteile an dem von der Verwaltungsgesellschaft festgesetzten monatlichen Umtauschdatum automatisch in A-Anteile desselben Portfolios umgetauscht und unterliegen nach dem Umtausch der Gebührenstruktur der A-Anteile. Insbesondere die bedingte gestaffelte Rücknahmegebühr und die Vertriebsgebühr werden dann nicht mehr erhoben.

6 PROVISIONSTEILUNGSVEREINBARUNGEN

Die Verwaltungsgesellschaft und bestimmte Unterberater dürfen Vereinbarungen über die Aufteilung von Provisionen mit Makler-Händlern schließen. Im Rahmen dieser Vereinbarungen stellen diese Makler-Händler direkt oder über Dritte bestimmte gewerbliche Dienstleistungen bereit, die sie aus den für die Aufträge der SICAV erhaltenen Provisionen bezahlen. Im Einklang mit dem „Best-Execution“-Grundsatz können die Verwaltungsgesellschaft bzw. jeder betreffende Unterberater Brokerprovisionen für Portfoliotransaktionen der SICAV spezifischen Brokern im Gegenzug für Research-Dienste Zusätzliche Informationen zu den Praktiken der einzelnen Unterberater in Bezug auf Vereinbarungen über die Aufteilung von Provisionen finden Sie im Abschnitt „Anlageberatungsvereinbarungen“ des Prospekts.

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

Ab dem 3. Januar 2018 dürfen nur die Unterberater Columbia und STANLIB Vereinbarungen über die Aufteilung von Provisionen abschließen.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

Die SICAV hat in der Berichtsperiode zum 31. März 2018 die folgenden Dividenden erklärt:

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	Klasse DEC	24.04.2017	USD	0,025	970
	Klasse DEC	22.05.2017	USD	0,026	1.008
	Klasse DEC	26.06.2017	USD	0,026	1.005
	Klasse DEC	25.07.2017	USD	0,027	992
	Klasse DEC	24.08.2017	USD	0,027	984
	Klasse DEC	25.09.2017	USD	0,030	1.084
	Klasse DEC	25.10.2017	USD	0,029	1.058
	Klasse DEC	24.11.2017	USD	0,030	897
	Klasse DEC	21.12.2017	USD	0,030	1.008
	Klasse DEC	25.01.2018	USD	0,031	1.051
	Klasse DEC	22.02.2018	USD	0,031	1.045
	Klasse DEC	23.03.2018	USD	0,032	1.052
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Klasse AEC	25.09.2017	USD	0,103	19
	Klasse AEC	23.03.2018	USD	0,046	650
	Klasse AUP	25.09.2017	USD	0,091	22
	Klasse AUP	21.12.2017	USD	0,059	137
	Klasse DEC	23.03.2018	USD	0,055	227
	Klasse NGC	23.03.2018	USD	0,030	3.573
					USD 4.628
Threadneedle (Lux) - European Social Bond*	Klasse IEP	26.06.2017	EUR	0,014	1.556
	Klasse IEP	25.09.2017	EUR	0,039	8.663
	Klasse IEP	21.12.2017	EUR	0,021	16.468
	Klasse IEP	23.03.2018	EUR	0,039	37.018
					EUR 63.705
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Klasse AEP	24.04.2017	EUR	0,029	12.369
	Klasse AEP	22.05.2017	EUR	0,029	12.287
	Klasse AEP	26.06.2017	EUR	0,035	14.155
	Klasse AEP	25.07.2017	EUR	0,035	12.964
	Klasse AEP	24.08.2017	EUR	0,035	12.921
	Klasse AEP	25.09.2017	EUR	0,038	14.408
	Klasse AEP	25.10.2017	EUR	0,038	14.120
	Klasse AEP	24.11.2017	EUR	0,038	14.182
	Klasse AEP	21.12.2017	EUR	0,038	13.284
	Klasse AEP	25.01.2018	EUR	0,038	13.021
	Klasse AEP	22.02.2018	EUR	0,038	12.695
	Klasse AEP	23.03.2018	EUR	0,038	12.760
	Klasse DEP	24.04.2017	EUR	0,022	8.847
	Klasse DEP	22.05.2017	EUR	0,022	8.993
	Klasse DEP	26.06.2017	EUR	0,027	11.869
	Klasse DEP	25.07.2017	EUR	0,027	12.601
	Klasse DEP	24.08.2017	EUR	0,027	13.759
	Klasse DEP	25.09.2017	EUR	0,029	15.776
	Klasse DEP	25.10.2017	EUR	0,029	16.584
	Klasse DEP	24.11.2017	EUR	0,029	16.934
	Klasse DEP	21.12.2017	EUR	0,029	16.877

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond (Fortsetzung)	Klasse DEP	25.01.2018	EUR	0,029	16.356
	Klasse DEP	22.02.2018	EUR	0,029	16.196
	Klasse DEP	23.03.2018	EUR	0,029	15.864
					EUR 329.822
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	Klasse AEC	24.04.2017	USD	0,071	33.531
	Klasse AEC	22.05.2017	USD	0,074	34.672
	Klasse AEC	26.06.2017	USD	0,074	34.672
	Klasse AEC	25.07.2017	USD	0,077	36.172
	Klasse AEC	24.08.2017	USD	0,078	36.173
	Klasse AEC	25.09.2017	USD	0,080	37.149
	Klasse AEC	25.10.2017	USD	0,079	35.492
	Klasse AEC	24.11.2017	USD	0,079	35.659
	Klasse AEC	21.12.2017	USD	0,080	35.559
	Klasse AEC	25.01.2018	USD	0,083	36.548
	Klasse AEC	22.02.2018	USD	0,083	35.700
	Klasse AEC	23.03.2018	USD	0,075	32.488
	Klasse AUP	24.04.2017	USD	0,038	37.887
	Klasse AUP	22.05.2017	USD	0,038	37.130
	Klasse AUP	26.06.2017	USD	0,039	37.581
	Klasse AUP	25.07.2017	USD	0,039	37.410
	Klasse AUP	24.08.2017	USD	0,039	36.758
	Klasse AUP	25.09.2017	USD	0,039	36.491
	Klasse AUP	25.10.2017	USD	0,039	36.315
	Klasse AUP	24.11.2017	USD	0,039	36.197
	Klasse AUP	21.12.2017	USD	0,039	36.235
	Klasse AUP	25.01.2018	USD	0,039	36.127
	Klasse AUP	22.02.2018	USD	0,039	36.013
	Klasse AUP	23.03.2018	USD	0,036	33.032
	Klasse DEC	24.04.2017	USD	0,052	1.397
	Klasse DEC	22.05.2017	USD	0,055	1.463
	Klasse DEC	26.06.2017	USD	0,054	2.876
	Klasse DEC	25.07.2017	USD	0,056	3.154
	Klasse DEC	24.08.2017	USD	0,057	3.415
	Klasse DEC	25.09.2017	USD	0,059	3.698
	Klasse DEC	25.10.2017	USD	0,058	3.742
	Klasse DEC	24.11.2017	USD	0,058	4.195
	Klasse DEC	21.12.2017	USD	0,058	4.305
	Klasse DEC	25.01.2018	USD	0,061	4.675
	Klasse DEC	22.02.2018	USD	0,060	3.275
	Klasse DEC	23.03.2018	USD	0,054	2.939
	Klasse P	24.04.2017	USD	0,044	255
	Klasse P	22.05.2017	USD	0,044	255
					USD 900.635

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	Klasse AEC	24.04.2017	USD	0,059	5.265
	Klasse AEC	22.05.2017	USD	0,062	5.809
	Klasse AEC	26.06.2017	USD	0,064	6.002
	Klasse AEC	25.07.2017	USD	0,066	6.466
	Klasse AEC	24.08.2017	USD	0,067	6.563
	Klasse AEC	25.09.2017	USD	0,072	7.510
	Klasse AEC	25.10.2017	USD	0,071	7.264
	Klasse AEC	24.11.2017	USD	0,071	7.354
	Klasse AEC	21.12.2017	USD	0,071	7.450
	Klasse AEC	25.01.2018	USD	0,074	8.141
	Klasse AEC	22.02.2018	USD	0,074	8.536
	Klasse AEC	23.03.2018	USD	0,064	7.322
	Klasse AUP	24.04.2017	USD	0,061	376.339
	Klasse AUP	22.05.2017	USD	0,061	373.355
	Klasse AUP	26.06.2017	USD	0,064	387.637
	Klasse AUP	25.07.2017	USD	0,064	384.216
	Klasse AUP	24.08.2017	USD	0,064	378.953
	Klasse AUP	25.09.2017	USD	0,067	387.300
	Klasse AUP	25.10.2017	USD	0,067	381.830
	Klasse AUP	24.11.2017	USD	0,067	376.954
	Klasse AUP	21.12.2017	USD	0,067	374.129
	Klasse AUP	25.01.2018	USD	0,067	370.796
	Klasse AUP	22.02.2018	USD	0,067	368.904
	Klasse AUP	23.03.2018	USD	0,059	322.026
	Klasse SUP	24.04.2017	USD	0,059	9.778
	Klasse SUP	22.05.2017	USD	0,059	9.431
	Klasse SUP	26.06.2017	USD	0,062	9.892
	Klasse SUP	25.07.2017	USD	0,062	9.527
	Klasse SUP	24.08.2017	USD	0,062	9.527
	Klasse SUP	25.09.2017	USD	0,065	9.876
	Klasse SUP	25.10.2017	USD	0,065	9.707
	Klasse SUP	24.11.2017	USD	0,065	9.308
	Klasse SUP	21.12.2017	USD	0,065	9.308
Klasse SUP	25.01.2018	USD	0,065	9.210	
Klasse SUP	22.02.2018	USD	0,065	8.594	
Klasse SUP	23.03.2018	USD	0,057	7.385	
					USD 4.677.664
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	Klasse AEC	24.04.2017	USD	0,035	39.735
	Klasse AEC	22.05.2017	USD	0,037	42.714
	Klasse AEC	26.06.2017	USD	0,033	39.243
	Klasse AEC	25.07.2017	USD	0,035	37.024
	Klasse AEC	24.08.2017	USD	0,035	39.082
	Klasse AEC	25.09.2017	USD	0,036	39.236
	Klasse AEC	25.10.2017	USD	0,035	40.373
	Klasse AEC	24.11.2017	USD	0,036	42.107
	Klasse AEC	21.12.2017	USD	0,036	42.645
	Klasse AEC	25.01.2018	USD	0,037	44.727
	Klasse AEC	22.02.2018	USD	0,037	44.992
	Klasse AEC	23.03.2018	USD	0,037	44.182

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds (Fortsetzung)	Klasse ASC	24.04.2017	USD	0,030	2.071
	Klasse ASC	22.05.2017	USD	0,030	2.235
	Klasse ASC	26.06.2017	USD	0,028	3.093
	Klasse ASC	25.07.2017	USD	0,029	2.178
	Klasse ASC	24.08.2017	USD	0,029	2.207
	Klasse ASC	25.09.2017	USD	0,029	2.241
	Klasse ASC	25.10.2017	USD	0,029	2.211
	Klasse ASC	24.11.2017	USD	0,029	2.035
	Klasse ASC	21.12.2017	USD	0,029	2.088
	Klasse ASC	25.01.2018	USD	0,030	2.054
	Klasse ASC	22.02.2018	USD	0,030	1.780
	Klasse ASC	23.03.2018	USD	0,030	2.144
	Klasse AUP	24.04.2017	USD	0,032	107.789
	Klasse AUP	22.05.2017	USD	0,032	107.074
	Klasse AUP	26.06.2017	USD	0,029	96.074
	Klasse AUP	25.07.2017	USD	0,029	95.245
	Klasse AUP	24.08.2017	USD	0,029	94.302
	Klasse AUP	25.09.2017	USD	0,030	91.568
	Klasse AUP	25.10.2017	USD	0,030	88.695
	Klasse AUP	24.11.2017	USD	0,030	86.636
	Klasse AUP	21.12.2017	USD	0,030	86.503
	Klasse AUP	25.01.2018	USD	0,030	84.655
	Klasse AUP	22.02.2018	USD	0,030	83.865
	Klasse AUP	23.03.2018	USD	0,030	119.426
					USD 1.664.229
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	Klasse AEC	24.04.2017	USD	0,066	10.303
	Klasse AEC	22.05.2017	USD	0,069	9.838
	Klasse AEC	26.06.2017	USD	0,069	9.825
	Klasse AEC	25.07.2017	USD	0,072	10.022
	Klasse AEC	24.08.2017	USD	0,073	5.123
	Klasse AEC	25.09.2017	USD	0,074	6.262
	Klasse AEC	25.10.2017	USD	0,073	6.014
	Klasse AEC	24.11.2017	USD	0,073	6.007
	Klasse AEC	21.12.2017	USD	0,074	5.576
	Klasse AEC	25.01.2018	USD	0,077	7.104
	Klasse AEC	22.02.2018	USD	0,076	7.024
	Klasse AEC	23.03.2018	USD	0,073	6.653
	Klasse AUP	24.04.2017	USD	0,060	50.561
	Klasse AUP	22.05.2017	USD	0,060	47.957
	Klasse AUP	26.06.2017	USD	0,061	45.630
	Klasse AUP	25.07.2017	USD	0,061	34.706
	Klasse AUP	24.08.2017	USD	0,061	34.662
	Klasse AUP	25.09.2017	USD	0,061	34.399
	Klasse AUP	25.10.2017	USD	0,061	30.268
	Klasse AUP	24.11.2017	USD	0,061	31.162
	Klasse AUP	21.12.2017	USD	0,061	30.788
	Klasse AUP	25.01.2018	USD	0,061	30.301
	Klasse AUP	22.02.2018	USD	0,061	29.958

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond (Fortsetzung)	Klasse AUP	23.03.2018	USD	0,058	28.029
	Klasse BUP	25.01.2018	USD	0,044	49
	Klasse BUP	22.02.2018	USD	0,044	49
	Klasse BUP	23.03.2018	USD	0,042	47
	Klasse DEC	24.04.2017	USD	0,050	4.131
	Klasse DEC	22.05.2017	USD	0,053	4.123
	Klasse DEC	26.06.2017	USD	0,054	4.197
	Klasse DEC	25.07.2017	USD	0,056	4.425
	Klasse DEC	24.08.2017	USD	0,057	4.492
	Klasse DEC	25.09.2017	USD	0,056	4.198
	Klasse DEC	25.10.2017	USD	0,055	4.090
	Klasse DEC	24.11.2017	USD	0,056	3.884
	Klasse DEC	21.12.2017	USD	0,056	3.937
	Klasse DEC	25.01.2018	USD	0,058	3.923
	Klasse DEC	22.02.2018	USD	0,058	3.959
	Klasse DEC	23.03.2018	USD	0,055	3.763
	Klasse IEC	24.08.2017	USD	0,052	5.384
	Klasse IEC	25.09.2017	USD	0,053	5.454
	Klasse IEC	25.10.2017	USD	0,052	7.178
	Klasse IEC	24.11.2017	USD	0,052	7.216
	Klasse IEC	21.12.2017	USD	0,052	7.100
	Klasse IEC	25.01.2018	USD	0,054	7.403
	Klasse IEC	22.02.2018	USD	0,054	5.051
	Klasse IEC	23.03.2018	USD	0,052	4.856
	Klasse XUP	26.06.2017	USD	0,139	47.460
	Klasse XUP	25.09.2017	USD	0,140	56.398
	Klasse XUP	21.12.2017	USD	0,069	69.613
	Klasse XUP	23.03.2018	USD	0,135	203.721
					USD 994.273
Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	Klasse IEC	26.06.2017	USD	0,087	96.846
	Klasse IEC	25.09.2017	USD	0,096	106.554
	Klasse IEC	21.12.2017	USD	0,093	103.139
	Klasse IEC	23.03.2018	USD	0,107	8.867
	Klasse IUP	26.06.2017	USD	0,080	7.952
	Klasse IUP	25.09.2017	USD	0,083	8.250
	Klasse IUP	21.12.2017	USD	0,080	7.952
	Klasse IUP	23.03.2018	USD	0,090	8.946
					USD 348.506
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	Klasse ASC	24.04.2017	USD	0,017	12
	Klasse ASC	22.05.2017	USD	0,017	12
	Klasse ASC	26.06.2017	USD	0,027	19
	Klasse ASC	25.07.2017	USD	0,027	19
	Klasse ASC	24.08.2017	USD	0,027	19
	Klasse ASC	25.09.2017	USD	0,028	19
	Klasse ASC	25.10.2017	USD	0,027	19
	Klasse ASC	24.11.2017	USD	0,027	39
	Klasse ASC	21.12.2017	USD	0,028	39

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond (Fortsetzung)	Klasse ASC	25.01.2018	USD	0,028	40
	Klasse ASC	22.02.2018	USD	0,028	40
	Klasse ASC	23.03.2018	USD	0,027	39
	Klasse AUP	24.04.2017	USD	0,033	44
	Klasse AUP	22.05.2017	USD	0,033	43
	Klasse AUP	26.06.2017	USD	0,036	47
	Klasse AUP	25.07.2017	USD	0,036	47
	Klasse AUP	24.08.2017	USD	0,036	47
	Klasse AUP	25.09.2017	USD	0,037	50
	Klasse AUP	25.10.2017	USD	0,037	49
					USD 643
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	Klasse AEC	24.04.2017	USD	0,019	1.958
	Klasse AEC	22.05.2017	USD	0,020	2.036
	Klasse AEC	26.06.2017	USD	0,020	2.063
	Klasse AEC	25.07.2017	USD	0,021	2.153
	Klasse AEC	24.08.2017	USD	0,021	2.079
	Klasse AEC	25.09.2017	USD	0,024	2.358
	Klasse AEC	25.10.2017	USD	0,024	2.306
	Klasse AEC	24.11.2017	USD	0,024	2.335
	Klasse AEC	21.12.2017	USD	0,024	3.336
	Klasse AEC	25.01.2018	USD	0,025	3.585
	Klasse AEC	22.02.2018	USD	0,025	3.649
	Klasse AEC	23.03.2018	USD	0,018	3.005
	Klasse AUP	24.04.2017	USD	0,019	16.574
	Klasse AUP	22.05.2017	USD	0,019	16.534
	Klasse AUP	26.06.2017	USD	0,019	16.345
	Klasse AUP	25.07.2017	USD	0,019	15.844
	Klasse AUP	24.08.2017	USD	0,019	15.752
	Klasse AUP	25.09.2017	USD	0,021	17.059
	Klasse AUP	25.10.2017	USD	0,021	16.888
	Klasse AUP	24.11.2017	USD	0,021	16.522
	Klasse AUP	21.12.2017	USD	0,021	16.312
	Klasse AUP	25.01.2018	USD	0,021	16.171
	Klasse AUP	22.02.2018	USD	0,021	15.844
	Klasse AUP	23.03.2018	USD	0,016	11.859
					USD 222.567
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Klasse AEC	26.06.2017	USD	0,136	559.362
	Klasse AEC	25.09.2017	USD	0,146	779.801
	Klasse AEC	21.12.2017	USD	0,234	1.651.357
	Klasse AEC	23.03.2018	USD	0,186	1.733.588
	Klasse AEP	26.06.2017	USD	0,150	73.055
	Klasse AEP	25.09.2017	USD	0,151	82.883
	Klasse AEP	21.12.2017	USD	0,244	143.254
	Klasse AEP	23.03.2018	USD	0,187	108.972
	Klasse AUP	26.06.2017	USD	0,131	71.697
	Klasse AUP	25.09.2017	USD	0,132	77.785
	Klasse AUP	21.12.2017	USD	0,213	138.583
	Klasse AUP	23.03.2018	USD	0,165	121.859

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income (Fortsetzung)	Klasse DEC	26.06.2017	USD	0,134	505.282
	Klasse DEC	25.09.2017	USD	0,144	624.349
	Klasse DEC	21.12.2017	USD	0,228	1.326.357
	Klasse DEC	23.03.2018	USD	0,181	1.302.612
	Klasse DEP	26.06.2017	USD	0,145	47.904
	Klasse DEP	25.09.2017	USD	0,146	53.926
	Klasse DEP	21.12.2017	USD	0,235	89.782
	Klasse DEP	23.03.2018	USD	0,181	67.086
	Klasse DUP	26.06.2017	USD	0,123	255.789
	Klasse DUP	25.09.2017	USD	0,124	266.400
	Klasse DUP	21.12.2017	USD	0,199	427.838
	Klasse DUP	23.03.2018	USD	0,154	332.460
	Klasse ZEC	26.06.2017	USD	0,142	11.342
	Klasse ZEC	25.09.2017	USD	0,152	4.220
	Klasse ZEC	21.12.2017	USD	0,245	45
Threadneedle (Lux) - Global Focus	Klasse AEP	25.09.2017	USD	0,090	797
	Klasse AEP	23.03.2018	USD	0,055	816
	Klasse ZEP	25.09.2017	USD	0,104	369.704
	Klasse ZEP	23.03.2018	USD	0,060	218.495
					USD 589.812
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	Klasse XUP	25.09.2017	USD	0,215	1.461.224
	Klasse XUP	23.03.2018	USD	0,060	497.487
					USD 1.958.711
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	Klasse ASC	24.04.2017	USD	0,021	42.937
	Klasse ASC	22.05.2017	USD	0,022	41.907
	Klasse ASC	26.06.2017	USD	0,022	39.566
	Klasse ASC	25.07.2017	USD	0,022	37.225
	Klasse ASC	24.08.2017	USD	0,022	34.123
	Klasse ASC	25.09.2017	USD	0,024	34.535
	Klasse ASC	25.10.2017	USD	0,023	33.141
	Klasse ASC	24.11.2017	USD	0,024	32.659
	Klasse ASC	21.12.2017	USD	0,024	32.103
	Klasse ASC	25.01.2018	USD	0,024	34.466
	Klasse ASC	22.02.2018	USD	0,024	32.325
	Klasse ASC	23.03.2018	USD	0,027	34.955
	Klasse AUP	24.04.2017	USD	0,030	4.080
	Klasse AUP	22.05.2017	USD	0,030	4.078
	Klasse AUP	26.06.2017	USD	0,031	4.210
	Klasse AUP	25.07.2017	USD	0,031	3.756
	Klasse AUP	24.08.2017	USD	0,031	4.592
	Klasse AUP	25.09.2017	USD	0,033	4.288
	Klasse AUP	25.10.2017	USD	0,033	4.297
	Klasse AUP	24.11.2017	USD	0,033	4.269
Klasse AUP	21.12.2017	USD	0,033	4.269	

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income (Fortsetzung)	Klasse AUP	25.01.2018	USD	0,033	4.771
	Klasse AUP	22.02.2018	USD	0,033	6.152
	Klasse AUP	23.03.2018	USD	0,036	6.795
	Klasse AVC	24.04.2017	USD	0,023	2.818
	Klasse AVC	22.05.2017	USD	0,022	2.628
	Klasse AVC	26.06.2017	USD	0,023	2.471
	Klasse AVC	25.07.2017	USD	0,024	2.390
	Klasse AVC	24.08.2017	USD	0,024	1.153
	Klasse AVC	25.09.2017	USD	0,026	915
	Klasse AVC	25.10.2017	USD	0,025	921
	Klasse AVC	24.11.2017	USD	0,024	975
	Klasse AVC	21.12.2017	USD	0,025	985
	Klasse AVC	25.01.2018	USD	0,026	2.437
	Klasse AVC	22.02.2018	USD	0,025	2.850
	Klasse AVC	23.03.2018	USD	0,026	3.090
					USD 509.132
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	Klasse AEC	25.09.2017	USD	0,128	266
	Klasse AEC	23.03.2018	USD	0,140	284
	Klasse AUP	25.09.2017	USD	0,115	996
	Klasse AUP	23.03.2018	USD	0,100	919
					USD 2.465
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities*	Klasse AUP	25.09.2017	USD	0,051	5.080
	Klasse AUP	23.03.2018	USD	0,104	10.358
	Klasse IEC	25.09.2017	USD	0,060	10
	Klasse IEC	23.03.2018	USD	0,122	21
					USD 15.469
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	Klasse ZUP	25.09.2017	USD	0,292	33.178
	Klasse ZUP	23.03.2018	USD	0,132	35.954
					USD 69.132
Threadneedle (Lux) - UK Equities	Klasse AGP	25.09.2017	GBP	0,496	241.322
	Klasse AGP	23.03.2018	GBP	0,259	143.023
	Klasse IGP	25.09.2017	GBP	0,701	878.011
	Klasse IGP	23.03.2018	GBP	0,424	619.641
	Klasse ZGP	25.09.2017	GBP	0,254	159.237
	Klasse ZGP	23.03.2018	GBP	0,152	98.618
					GBP 2.139.852
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	Klasse AEC	25.09.2017	GBP	0,069	8
	Klasse AEC	21.12.2017	GBP	0,059	7
	Klasse AEC	23.03.2018	GBP	0,069	8
	Klasse ASC	25.09.2017	GBP	0,017	3
	Klasse ASC	21.12.2017	GBP	0,015	3
	Klasse ASC	23.03.2018	GBP	0,043	8
	Klasse AUC	25.09.2017	GBP	0,042	5
	Klasse AUC	21.12.2017	GBP	0,037	5

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income (Fortsetzung)	Klasse AUC	23.03.2018	GBP	0,058	7
	Klasse DEC	25.09.2017	GBP	0,069	8
	Klasse DEC	21.12.2017	GBP	0,059	7
	Klasse DEC	23.03.2018	GBP	0,068	8
	Klasse IGP	26.06.2017	GBP	0,141	99.336
	Klasse IGP	25.09.2017	GBP	0,090	74.425
	Klasse IGP	21.12.2017	GBP	0,084	72.456
	Klasse IGP	23.03.2018	GBP	0,071	89.297
	Klasse LGP	26.06.2017	GBP	0,150	542.466
	Klasse LGP	25.09.2017	GBP	0,095	380.486
	Klasse LGP	21.12.2017	GBP	0,082	354.833
	Klasse LGP	23.03.2018	GBP	0,074	358.454
					GBP 1.971.830

*Siehe Erläuterung 1.

8 ERFOLGSgebühren

Die Verwaltungsgesellschaft erhält in Bezug auf alle Anteilsklassen der in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Portfolios eine Performance-Gebühr. Für die Erfolgsgebühr werden tägliche Rückstellungen im Hinblick auf den Saldo der Erfolgsgebühr gebildet (wie nachstehend beschrieben), wobei der aufgelaufene Betrag am Ende jedes Kalenderjahres (d. h. am 31. Dezember) an die Verwaltungsgesellschaft ausbezahlt wird. Die Höhe dieser Performance-Gebühr hängt von der Wertentwicklung des Nettoinventarwertes (NAV) der betreffenden Anteilklasse innerhalb des betreffenden Portfolios im Vergleich zu der Wertentwicklung des jeweiligen Performance-Index ab (der „Performance-Index“, wie in der nachstehenden Tabelle ausgeführt). Es laufen nur dann Gebühren auf, wenn der Saldo der Performance-Gebühr positiv ist und die NAV-High-Water-Mark (wie nachstehend definiert) überschritten wird.

Die Performance der Anteilsklassen beinhaltet die ausgeschütteten Dividenden.

Portfolio	Anteilklasse	Performance-Index	Performance-Satz
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	A-Anteile	Der höhere Wert des 3-Monats-LIBOR (USD) oder Null	20 %
	D-Anteile		
	I-Anteile		
	Z-Anteile		
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities*	J-Anteile	Der höhere Wert des FTSE EUR 1 Month Eurodeposit zuzüglich 1,00 % oder Null zuzüglich 1,00 %	10 %
	Y-Anteile		
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	A-Anteile	Der höhere Wert des 3-Monats-EURIBOR (EUR) oder Null	20 %
	D-Anteile		
	I-Anteile		
	Z-Anteile		
	L-Anteile		

Die Performance des Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolio, des Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities* Portfolio und des Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha Portfolio, unter Berücksichtigung aller anwendbaren Gebühren, wird mit dem Performance-Index verglichen.

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

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

8 ERFOLGSGEBÜHREN

(Fortsetzung)

- (i) Wenn der Tagesunterschied positiv ist, steigt der Saldo der Erfolgsgebühr um einen Betrag, der sich nach dem Tagesunterschied richtet und anhand des Erfolgsgebührensatzes bestimmt wird;
- (ii) ist der Tagesunterschied negativ, verringert sich der Saldo der Erfolgsgebühr um einen Betrag, der sich nach dem Tagesunterschied richtet und anhand des Erfolgsgebührensatzes bestimmt wird.

Ist der Saldo der Erfolgsgebühr am Ende des Kalenderjahres positiv und wurde die NIW High Water Mark überstiegen, so wird der aufgelaufene Betrag der Erfolgsgebühr innerhalb des ersten Quartals des folgenden Kalenderjahres an die Verwaltungsgesellschaft gezahlt. Eine Performance-Gebühr wird an die Verwaltungsgesellschaft nur in dem Fall gezahlt, dass der Nettoinventarwert der betreffenden Anteilklasse über der NAV-High-Water-Mark liegt.

Ist der Saldo der Performance-Gebühr zum Ende des Kalenderjahres negativ und wurde die NAV-High-Water-Mark überschritten, wird der negative Betrag zurückgesetzt. Zur Klarstellung: In diesem Fall wäre keine Performance-Gebühr zu zahlen.

Wenn am Ende des Kalenderjahres der Saldo der Performance Gebühr negativ ist und der Höchststand des Nettoinventarwerts nicht überschritten wurde, wird dieser negative Betrag vorgetragen und die Verwaltungsgesellschaft erhält so lange keine Erfolgsgebühr, bis die aufgelaufene Erfolgsgebühr am Ende eines nachfolgenden Kalenderjahres wieder positiv ausfällt und der Höchststand des Nettoinventarwerts überschritten wurde.

Falls ein Portfolio oder eine Anteilklasse liquidiert oder ein Portfolio oder eine Anteilklasse inaktiv gestellt werden, werden noch ausstehende, aufgelaufene Performance-Gebühren abgerechnet und an die Verwaltungsgesellschaft zahlbar. Legen im Anschluss daran neue Anteilinhaber in ein solches Portfolio oder eine solche Anteilklasse an, wird der Saldo der Performance-Gebühr zurückgesetzt.

NIW High Water Mark: Bezüglich der einzelnen Anteilklassen entspricht der Nettoinventarwert eines Anteils dieser Anteilklasse dem des letzten Bewertungsstichtags des letzten relevanten Kalenderjahres, in dem eine eventuell aufgelaufene Erfolgsgebühr bezahlt wurde. Wurde noch nie eine Performance-Gebühr gezahlt, entspricht die NAV-High-Water-Mark dem Anfangspreis der jeweiligen Anteilklasse.

Zum 31. März 2018 belief sich die Erfolgsgebühr auf 492 USD für Threadneedle (Lux) – American Absolute Alpha und 9 EUR für Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha.

*Siehe Erläuterung 1.

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

Zum 31. März 2018 hielt die SICAV die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	06.04.2018	CAD	25.031	USD	19.482	Handel	Goldman Sachs	(64)
	06.04.2018	EUR	97.730	USD	120.743	Handel	JP Morgan	(483)
	06.04.2018	GBP	20.396	USD	28.386	Handel	Lloyds	234
	06.04.2018	JPY	11.505.722	USD	107.569	Handel	JP Morgan	673
	06.04.2018	NOK	247.406	USD	31.908	Handel	Goldman Sachs	(387)
	06.04.2018	NZD	31.627	USD	23.177	Handel	Goldman Sachs	(361)
	06.04.2018	SEK	233.625	USD	28.437	Handel	Goldman Sachs	(526)
	19.04.2018	EUR	1.180.003	USD	1.467.355	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13.961)
	06.04.2018	MXN	6.072.460	USD	321.049	Handel	HSBC	11.224
	06.04.2018	USD	1.082.436	ZAR	12.768.497	Handel	Goldman Sachs	6.097
	06.04.2018	JPY	231.654.400	USD	2.170.276	Handel	Royal Bank of Scotland	9.052
	06.04.2018	CHF	113.300	USD	120.534	Handel	JP Morgan	(2.143)
	06.04.2018	AUD	312.980	USD	244.318	Handel	HSBC	(4.252)
	06.04.2018	KRW	254.429.306	USD	237.452	Handel	HSBC	1.860
	19.04.2018	EUR	19.975	USD	24.786	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(183)
	19.04.2018	EUR	285.578	USD	355.121	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.379)
	19.04.2018	EUR	447.432	USD	556.390	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.294)
	06.04.2018	JPY	45.950.742	USD	437.270	Handel	Barclays Capital	(4.981)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond (Fortsetzung)								
	06.04.2018	SEK	396.105	USD	47.889	Handel	Goldman Sachs	(566)
	06.04.2018	NOK	215.778	USD	27.253	Handel	Goldman Sachs	238
	06.04.2018	JPY	4.191.372	USD	39.355	Handel	Goldman Sachs	76
	06.04.2018	GBP	22.328	USD	30.750	Handel	Citibank	582
	06.04.2018	EUR	22.399	USD	27.386	Handel	Citibank	177
	06.04.2018	SEK	21.369.416	USD	2.594.151	Handel	Barclays Capital	(41.104)
	06.04.2018	NOK	6.827.390	USD	869.589	Handel	Goldman Sachs	247
	06.04.2018	EUR	715.952	SEK	7.301.830	Handel	HSBC	8.637
	06.04.2018	EUR	697.844	SEK	7.082.921	Handel	Royal Bank of Scotland	12.506
	06.04.2018	NOK	6.645.447	SEK	6.968.622	Handel	HSBC	14.094
	06.04.2018	USD	2.628.510	RUB	147.643.415	Handel	HSBC	61.147
	06.04.2018	USD	3.946	NZD	5.467	Handel	HSBC	2
	06.04.2018	USD	435.478	JPY	46.226.949	Handel	HSBC	590
	06.04.2018	USD	497.734	GBP	359.710	Handel	HSBC	(7.034)
	19.04.2018	USD	1.862	EUR	1.502	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	06.04.2018	USD	115.161	EUR	93.579	Handel	JP Morgan	8
	06.04.2018	USD	73.039	EUR	59.600	Handel	UBS AG Stamford Branch	(301)
	19.04.2018	USD	11.044	EUR	8.936	Absicherung	JP Morgan Chase New York	38
	06.04.2018	USD	705.036	CAD	900.860	Handel	HSBC	6.178
								USD 48.653
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond								
	19.04.2018	EUR	13.890.111	USD	17.272.603	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(164.348)
	19.04.2018	EUR	1.034.134	USD	1.285.964	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12.236)
	19.04.2018	EUR	35.935	USD	44.686	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(425)
	19.04.2018	EUR	30.972	USD	38.514	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(366)
	19.04.2018	GBP	21.429	USD	30.030	Absicherung	JP Morgan Chase New York	58
	19.04.2018	GBP	4.039	USD	5.643	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28
	19.04.2018	GBP	72.275	USD	100.765	Absicherung	JP Morgan Chase New York	713
	19.04.2018	GBP	35.754	USD	50.243	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43)
	19.04.2018	GBP	34.926	USD	49.079	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
	19.04.2018	GBP	250.008	USD	350.856	Absicherung	JP Morgan Chase New York	168
	19.04.2018	GBP	5.003	USD	7.045	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
	19.04.2018	GBP	16.763	USD	23.656	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(120)
	19.04.2018	GBP	7.000	USD	9.967	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(139)
	19.04.2018	GBP	26.076	USD	36.898	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(286)
	19.04.2018	GBP	390.759	USD	551.347	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.702)
	19.04.2018	GBP	19.680	USD	27.768	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(136)
	19.04.2018	GBP	20.033	USD	28.266	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(139)
	19.04.2018	GBP	148.708	USD	207.773	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.020
	19.04.2018	GBP	31.422	USD	43.902	Absicherung	JP Morgan Chase New York	215
	19.04.2018	GBP	76.520.589	USD	107.138.927	Absicherung	JP Morgan Chase New York	299.809
	19.04.2018	GBP	702.110	USD	983.046	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.751
	19.04.2018	GBP	5.911.812	USD	8.277.317	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23.162
	19.04.2018	GBP	902.189	USD	1.263.183	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.535

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond								
(Fortsetzung)	19.04.2018	SEK	17.358	USD	2.120	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
	19.04.2018	SEK	17.697	USD	2.161	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(45)
	30.04.2018	USD	1.129.890	CAD	1.451.838	Handel	Barclays Capital	3.098
	30.04.2018	USD	28.144.808	GBP	19.910.818	Handel	Barclays Capital	175.843
	30.04.2018	USD	27.064.766	EUR	21.806.705	Handel	Barclays Capital	184.071
	30.04.2018	USD	475.127	AUD	616.428	Handel	Barclays Capital	2.288
	30.04.2018	USD	940.581	GBP	665.490	Handel	Goldman Sachs	5.760
	30.04.2018	USD	14.667	CAD	18.930	Handel	Goldman Sachs	(25)
	30.04.2018	USD	4.374	AUD	5.694	Handel	Goldman Sachs	7
	19.04.2018	USD	37.194	GBP	26.541	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(71)
	19.04.2018	USD	1.769	GBP	1.260	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2018	EUR	149.862	USD	186.356	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.773)
	19.04.2018	EUR	1.887	USD	2.347	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.04.2018	EUR	40.498	USD	50.359	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(479)
	19.04.2018	GBP	18.502	USD	26.208	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(231)
	19.04.2018	GBP	211	USD	300	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2018	GBP	2.010	USD	2.862	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(40)
								USD 518.790
Threadneedle (Lux) - European Social Bond*								
	04.05.2018	EUR	368.713	USD	458.350	Handel	HSBC	(3.023)
	04.05.2018	EUR	129.314	GBP	114.820	Handel	Citibank	(1.515)
	04.05.2018	EUR	5.278	GBP	4.710	Handel	HSBC	(89)
	04.05.2018	EUR	120.701	GBP	106.170	Handel	HSBC	(270)
	04.05.2018	EUR	111.907	GBP	98.940	Handel	Citibank	(827)
	04.05.2018	EUR	831.980	GBP	739.993	Handel	HSBC	(11.187)
	04.05.2018	GBP	98.830	EUR	111.944	Handel	HSBC	664
	19.04.2018	CHF	3.262	EUR	2.790	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
	04.05.2018	GBP	4.141	EUR	4.650	Handel	HSBC	69
	04.05.2018	GBP	20.000	EUR	22.653	Handel	Citibank	135
	04.05.2018	GBP	5.854	EUR	6.721	Handel	HSBC	(51)
	04.05.2018	USD	2.128	EUR	1.723	Handel	HSBC	2
	04.05.2018	USD	136.000	EUR	110.252	Handel	Citibank	46
	19.04.2018	CHF	3.262	EUR	2.790	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
	04.05.2018	EUR	320	CAD	506	Handel	Citibank	1
	04.05.2018	EUR	464	CAD	719	Handel	HSBC	12
	04.05.2018	EUR	63.321	CAD	98.500	Handel	HSBC	1.319
								EUR (14.754)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond								
	06.04.2018	GBP	311.202	EUR	350.605	Handel	HSBC	4.281
	06.04.2018	USD	4.974.279	RUB	279.405.262	Handel	HSBC	94.088
	06.04.2018	USD	171.230	EUR	140.054	Handel	JP Morgan	(903)
	06.04.2018	USD	436.264	GBP	311.293	Handel	Barclays Capital	(459)
	06.04.2018	EUR	278.467	AUD	436.951	Handel	HSBC	6.106
	06.04.2018	EUR	15.346.765	GBP	13.587.030	Handel	HSBC	(147.523)
	06.04.2018	EUR	14.004.525	USD	17.163.274	Handel	Royal Bank of Scotland	56.776
	06.04.2018	EUR	421.600	GBP	373.663	Handel	HSBC	(4.516)
								EUR 7.850
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds								
	19.04.2018	EUR	552.560	USD	687.118	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.538)
	19.04.2018	EUR	8.039	USD	9.995	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(94)
	19.04.2018	EUR	1.906	USD	2.370	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.04.2018	EUR	283	USD	352	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2018	EUR	616	USD	768	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.04.2018	EUR	39.155	USD	48.409	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(183)
	19.04.2018	EUR	88	USD	108	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	9.986	USD	12.391	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(92)
	19.04.2018	EUR	5.842	USD	7.264	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(68)
	19.04.2018	EUR	84	USD	103	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	5.642.464	USD	7.016.506	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(66.762)
	19.04.2018	EUR	2.789.393	USD	3.468.660	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(33.004)
	19.04.2018	EUR	12.513.017	USD	15.560.164	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(148.055)
	19.04.2018	EUR	2.969	USD	3.649	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	19.04.2018	EUR	14.986	USD	18.419	Absicherung	JP Morgan Chase New York	39
	19.04.2018	EUR	83	USD	102	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	4.095	USD	5.050	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.04.2018	EUR	20	USD	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	6.035.765	USD	7.505.585	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(71.415)
	19.04.2018	EUR	146.552	USD	182.240	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.734)
	19.04.2018	EUR	3.056	USD	3.775	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.04.2018	EUR	8.205	USD	10.136	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(30)
	19.04.2018	EUR	139	USD	171	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	416	USD	513	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	SGD	29.246	USD	22.326	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.04.2018	USD	316	EUR	255	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2018	USD	4.848	EUR	3.911	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30
	19.04.2018	USD	5.744	EUR	4.649	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17
	19.04.2018	USD	82	EUR	66	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	USD	2.641	EUR	2.137	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.04.2018	USD	8.666	EUR	7.046	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
	13.04.2018	USD	1.355.568	RUB	78.151.969	Handel	Goldman Sachs	(2.091)
	13.04.2018	USD	439.146	EUR	357.480	Handel	Barclays Capital	(966)
	19.04.2018	USD	1.686	EUR	1.372	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds								
<i>(Fortsetzung)</i>	13.04.2018	USD	219.596	ZAR	2.570.520	Handel	Goldman Sachs	3.129
	19.04.2018	USD	541	EUR	437	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2018	USD	39.364	EUR	31.723	Absicherung	JP Morgan Chase New York	290
	19.04.2018	USD	31.091	EUR	25.056	Absicherung	JP Morgan Chase New York	229
	19.04.2018	USD	1.205	EUR	974	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
								USD (327.351)
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt								
	19.04.2018	EUR	276	USD	341	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	06.04.2018	ZAR	3.409.403	USD	289.391	Handel	HSBC	(1.988)
	19.04.2018	EUR	578.891	USD	719.862	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.849)
	19.04.2018	EUR	385.629	USD	479.536	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.563)
	19.04.2018	EUR	845.410	USD	1.051.283	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10.003)
	19.04.2018	EUR	10.000	USD	12.332	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
	19.04.2018	EUR	1.281.833	USD	1.593.982	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15.167)
	19.04.2018	SGD	384.498	USD	293.518	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(150)
	19.04.2018	EUR	2.990	USD	3.706	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
	19.04.2018	EUR	277	USD	341	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	06.04.2018	USD	1.754.110	ZAR	21.101.564	Handel	HSBC	(24.718)
	06.04.2018	USD	735.785	ZAR	8.635.196	Handel	Goldman Sachs	7.873
	19.04.2018	EUR	686	USD	849	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	13.04.2018	USD	1.189.091	EUR	968.000	Handel	HSBC	(2.665)
	19.04.2018	USD	21.904	EUR	17.792	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.04.2018	USD	23.380	EUR	18.916	Absicherung	JP Morgan Chase New York	80
	19.04.2018	USD	121.082	EUR	97.158	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.411
	19.04.2018	USD	19.513	EUR	15.658	Absicherung	JP Morgan Chase New York	227
	06.04.2018	USD	1.771.553	MXN	33.295.000	Handel	HSBC	(50.342)
	19.04.2018	USD	8.069	EUR	6.489	Absicherung	JP Morgan Chase New York	76
								USD (106.832)
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds								
	19.04.2018	USD	3.976	EUR	3.216	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
	19.04.2018	USD	46.183	EUR	37.143	Absicherung	JP Morgan Chase New York	435
	19.04.2018	USD	15.594	EUR	12.541	Absicherung	JP Morgan Chase New York	147
	19.04.2018	USD	5.694	EUR	4.594	Absicherung	JP Morgan Chase New York	36
	19.04.2018	USD	49	EUR	39	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	USD	489	EUR	396	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2018	USD	124	EUR	100	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	06.04.2018	USD	895.966	MXN	16.838.998	Handel	HSBC	(25.461)
	19.04.2018	USD	7.598	SGD	10.005	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(36)
	19.04.2018	USD	3.690	SGD	4.861	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	06.04.2018	ZAR	4.370.395	USD	370.960	Handel	HSBC	(2.548)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds (Fortsetzung)								
	19.04.2018	EUR	5.799.064	USD	7.211.241	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(68.615)
	19.04.2018	EUR	4.174.167	USD	5.190.651	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(49.389)
	19.04.2018	EUR	1.023	USD	1.257	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.04.2018	EUR	673	USD	830	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2018	EUR	450.000	USD	554.955	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(696)
	19.04.2018	EUR	13	USD	16	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	417	USD	513	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	3.952	USD	4.861	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2018	EUR	29.090	USD	35.753	Absicherung	JP Morgan Chase New York	77
	19.04.2018	EUR	18.076	USD	22.527	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(263)
	19.04.2018	EUR	11.995	USD	14.949	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(174)
	19.04.2018	EUR	24.975	USD	31.125	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(363)
	19.04.2018	EUR	999	USD	1.240	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.04.2018	EUR	9.990	USD	12.396	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(92)
	19.04.2018	EUR	14.213.905	USD	17.675.248	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(168.179)
	19.04.2018	EUR	4.400	USD	5.471	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(52)
	19.04.2018	EUR	83	USD	103	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2018	EUR	83	USD	102	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2018	EUR	1.000.000	USD	1.239.439	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7.753)
	19.04.2018	EUR	3.713	USD	4.587	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
	19.04.2018	EUR	24.088.848	USD	29.954.916	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(285.019)
	19.04.2018	EUR	7.674.263	USD	9.543.085	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(90.802)
	19.04.2018	EUR	778	USD	962	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2018	EUR	39.990	USD	49.442	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(187)
	19.04.2018	SGD	609	USD	464	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2018	SGD	8.053	USD	6.156	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.04.2018	SGD	3.912	USD	2.971	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14
	19.04.2018	SGD	99	USD	76	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	SGD	3.194	USD	2.436	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2018	SGD	1.380.707	USD	1.054.003	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(539)
	19.04.2018	SGD	604.106	USD	461.162	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(236)
	19.04.2018	SGD	616	USD	471	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	SGD	4.861	USD	3.693	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16
	19.04.2018	USD	32.128	EUR	25.892	Absicherung	JP Morgan Chase New York	237
	19.04.2018	USD	120.172	EUR	97.231	Absicherung	JP Morgan Chase New York	413
	19.04.2018	USD	42.612	EUR	34.477	Absicherung	JP Morgan Chase New York	147
	19.04.2018	USD	1.220	EUR	992	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2018	USD	6.208	EUR	5.051	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.04.2018	USD	362	EUR	294	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2018	USD	31.923	EUR	25.615	Absicherung	JP Morgan Chase New York	372
	19.04.2018	USD	248	EUR	200	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	06.04.2018	USD	1.873.051	ZAR	22.532.394	Handel	HSBC	(26.394)
	06.04.2018	USD	966.038	ZAR	11.337.453	Handel	Goldman Sachs	10.337

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds (Fortsetzung)								
	19.04.2018	USD	50.173	EUR	40.685	Absicherung	JP Morgan Chase New York	63
	19.04.2018	USD	54.025	EUR	43.808	Absicherung	JP Morgan Chase New York	68
	19.04.2018	USD	292.022	EUR	235.866	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.507
	19.04.2018	USD	1.016	EUR	822	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.04.2018	USD	443.004	EUR	357.813	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.287
	19.04.2018	USD	91.474	EUR	74.303	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
	19.04.2018	USD	1.661	EUR	1.349	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
								USD (710.730)
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond								
	19.04.2018	SGD	434	USD	332	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	230	USD	287	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2018	USD	3.630	SGD	4.782	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	19.04.2018	USD	17	SGD	23	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	USD	426	SGD	560	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2018	USD	33.470	SGD	44.079	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(161)
	19.04.2018	USD	1.505	SGD	1.971	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2018	USD	7.905	EUR	6.396	Absicherung	JP Morgan Chase New York	27
	19.04.2018	USD	144.161	EUR	116.641	Absicherung	JP Morgan Chase New York	496
	19.04.2018	USD	166.798	EUR	134.723	Absicherung	JP Morgan Chase New York	861
	19.04.2018	USD	134.122	EUR	108.330	Absicherung	JP Morgan Chase New York	692
	19.04.2018	USD	54.729	EUR	44.378	Absicherung	JP Morgan Chase New York	69
	19.04.2018	USD	45.509	EUR	36.601	Absicherung	JP Morgan Chase New York	428
	19.04.2018	USD	6.964	EUR	5.612	Absicherung	JP Morgan Chase New York	51
	19.04.2018	USD	6.033	EUR	4.841	Absicherung	JP Morgan Chase New York	70
	19.04.2018	EUR	150	USD	184	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	120.811	USD	148.587	Absicherung	JP Morgan Chase New York	214
	19.04.2018	EUR	7.124	USD	8.805	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(30)
	19.04.2018	SGD	482	USD	366	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2018	EUR	500	USD	616	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	SGD	1.223	USD	929	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.04.2018	EUR	125.078	USD	154.250	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(194)
	19.04.2018	EUR	26.123	USD	32.106	Absicherung	JP Morgan Chase New York	69
	19.04.2018	EUR	29.215	USD	35.907	Absicherung	JP Morgan Chase New York	77
	19.04.2018	SGD	5.929	USD	4.522	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2018	SGD	1.964	USD	1.501	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2018	SGD	888.354	USD	678.151	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(347)
	19.04.2018	SGD	361	USD	275	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	GBP	1.069	USD	1.497	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.04.2018	EUR	578	USD	714	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2018	EUR	1.100	USD	1.367	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.04.2018	EUR	893.227	USD	1.110.743	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10.569)
	19.04.2018	EUR	35.345	USD	43.952	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(418)
	19.04.2018	EUR	669.368	USD	832.371	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7.920)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond (Fortsetzung)	19.04.2018	EUR	1.241.013	USD	1.543.223	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14.684)
	19.04.2018	EUR	124.748.437	USD	155.126.927	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.476.024)
	19.04.2018	EUR	1.540.299	USD	1.915.391	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18.225)
	19.04.2018	EUR	1.483.203	USD	1.844.391	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17.549)
	19.04.2018	EUR	21	USD	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	2.273	USD	2.810	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
								USD (1.543.106)
Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	19.04.2018	CHF	969	USD	1.030	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
	19.04.2018	EUR	4.384	USD	5.452	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(52)
	19.04.2018	CHF	4.732	USD	5.030	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(81)
	19.04.2018	EUR	4.399	USD	5.471	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(52)
	19.04.2018	EUR	773.415	USD	961.755	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9.150)
	19.04.2018	EUR	4.332	USD	5.387	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(51)
	19.04.2018	EUR	4.356	USD	5.417	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(52)
								USD (9.455)
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	26.04.2018	USD	744.560	JPY	78.500.000	Handel	JP Morgan	5.127
	26.04.2018	USD	729.430	JPY	76.500.000	Handel	JP Morgan	8.828
	07.05.2018	USD	745.042	JPY	78.750.000	Handel	Barclays Capital	2.704
	07.05.2018	USD	740.488	JPY	78.750.000	Handel	JP Morgan	(1.839)
	16.04.2018	USD	486.305	KRW	525.000.000	Handel	Citibank	(7.599)
	16.04.2018	USD	980.649	KRW	1.050.000.000	Handel	Barclays Capital	(7.182)
	26.04.2018	USD	535.638	CNY	3.400.000	Handel	Citibank	(4.696)
	19.04.2018	USD	5.106	SGD	6.723	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24)
	19.04.2018	USD	198.243	SGD	259.341	Absicherung	JP Morgan Chase New York	369
	05.04.2018	USD	897.202	SGD	1.175.000	Handel	Citibank	994
	19.04.2018	USD	115.023	SGD	150.652	Absicherung	JP Morgan Chase New York	77
	19.04.2018	USD	622	SGD	815	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	06.04.2018	USD	480.280	PHP	25.000.000	Handel	Barclays Capital	2.134
	09.04.2018	THB	125.000.000	USD	3.980.258	Handel	Citibank	18.618
	19.04.2018	SGD	2.961	USD	2.261	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2018	SGD	15.538	USD	11.861	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.04.2018	SGD	1.853.222	USD	1.414.711	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(723)
	19.04.2018	SGD	26	USD	20	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	05.04.2018	SGD	1.175.000	USD	886.929	Handel	JP Morgan	9.279
	07.05.2018	SGD	4.175.000	USD	3.185.848	Handel	JP Morgan	975
	06.04.2018	PHP	25.000.000	USD	479.451	Handel	Citibank	(1.301)
	16.04.2018	KRW	5.800.000.000	USD	5.457.283	Handel	Citibank	(585)
	16.04.2018	KRW	1.550.000.000	USD	1.450.510	Handel	Citibank	7.746
	07.05.2018	JPY	52.500.000	USD	493.216	Handel	JP Morgan	1.672
	07.05.2018	JPY	52.500.000	USD	491.202	Handel	JP Morgan	3.686
	07.05.2018	JPY	52.500.000	USD	490.981	Handel	JP Morgan	3.906

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond <i>(Fortsetzung)</i>								
	26.04.2018	JPY	77.500.000	USD	735.447	Handel	Barclays Capital	(5.442)
	26.04.2018	JPY	77.500.000	USD	734.784	Handel	Citibank	(4.779)
	19.04.2018	GBP	14.304.168	USD	20.027.724	Absicherung	JP Morgan Chase New York	56.045
	19.04.2018	EUR	2.830	USD	3.519	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(33)
	19.04.2018	EUR	62.266	USD	77.429	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(737)
	19.04.2018	EUR	678.649	USD	843.912	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8.030)
	19.04.2018	EUR	24.975	USD	30.878	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(117)
	26.04.2018	CNY	3.400.000	USD	533.668	Handel	Citibank	6.660
	19.04.2018	AUD	1.031	USD	812	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.04.2018	AUD	1.031	USD	812	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
								USD 85.683
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation								
	19.04.2018	USD	18.491	EUR	14.961	Absicherung	JP Morgan Chase New York	64
	19.04.2018	USD	30.415	EUR	24.511	Absicherung	JP Morgan Chase New York	224
	19.04.2018	USD	6.098	EUR	4.945	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	19.04.2018	USD	8.580	EUR	6.981	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
	19.04.2018	USD	60.859	EUR	49.482	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(88)
	19.04.2018	GBP	1.196.185	USD	1.674.817	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.687
	19.04.2018	EUR	4.985	USD	6.161	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21)
	19.04.2018	EUR	14.838	USD	18.267	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.04.2018	EUR	14.268	USD	17.704	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(131)
	19.04.2018	EUR	7.890	USD	9.790	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(72)
	19.04.2018	EUR	171	USD	212	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2018	EUR	4.985	USD	6.127	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2018	EUR	10.121	USD	12.531	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(65)
	19.04.2018	EUR	110	USD	138	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2018	EUR	19.975	USD	24.894	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(291)
	19.04.2018	EUR	182	USD	227	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2018	EUR	21.970	USD	27.230	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(170)
	19.04.2018	EUR	293	USD	362	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2018	EUR	49.988	USD	61.753	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(184)
	19.04.2018	EUR	12.318.841	USD	15.318.700	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(145.756)
	19.04.2018	EUR	3.827.040	USD	4.758.993	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(45.282)
	19.04.2018	EUR	2.195.253	USD	2.729.837	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(25.974)
	19.04.2018	EUR	29.375	USD	36.409	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(228)
	19.04.2018	EUR	5.690	USD	7.052	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
	19.04.2018	EUR	5.700	USD	7.042	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21)
	19.04.2018	EUR	100	USD	123	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	01.06.2018	JPY	802.000.001	USD	7.540.464	Handel	Royal Bank of Scotland	32.677
	01.06.2018	EUR	2.500.000	USD	3.095.803	Handel	Royal Bank of Scotland	(6.745)
	01.06.2018	USD	2.908.849	MXN	55.054.999	Handel	Goldman Sachs	(77.405)
	01.06.2018	USD	2.514.222	AUD	3.206.000	Handel	Citibank	54.801
	01.06.2018	USD	582.899	GBP	416.000	Handel	Citibank	(2.204)
								USD (212.223)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income								
	19.04.2018	EUR	36.668	USD	45.398	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(235)
	19.04.2018	EUR	150.633	USD	186.497	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(964)
	19.04.2018	EUR	19.975	USD	24.731	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(128)
	19.04.2018	EUR	250.740	USD	309.900	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.067)
	19.04.2018	EUR	325.446	USD	402.233	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.385)
	19.04.2018	EUR	27.988	USD	34.592	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(119)
	19.04.2018	EUR	367.130	USD	451.539	Absicherung	JP Morgan Chase New York	650
	19.04.2018	EUR	34.882.553	USD	43.377.082	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(412.729)
	19.04.2018	EUR	151.408	USD	188.278	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.791)
	19.04.2018	EUR	146.958	USD	183.144	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.138)
	19.04.2018	EUR	398.078	USD	496.098	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.791)
	19.04.2018	EUR	86.708.548	USD	107.823.641	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.025.935)
	04.04.2018	AUD	224.980	USD	172.920	Handel	Goldman Sachs	(353)
	19.04.2018	EUR	163.616	USD	201.092	Absicherung	JP Morgan Chase New York	431
	19.04.2018	EUR	128.413	USD	160.032	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.868)
	19.04.2018	EUR	22.576	USD	28.134	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(328)
	19.04.2018	EUR	95.395	USD	118.371	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(874)
	19.04.2018	EUR	74.321	USD	92.221	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(681)
	19.04.2018	EUR	19.975	USD	24.786	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(183)
	19.04.2018	EUR	65.651.692	USD	81.639.061	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(776.790)
	19.04.2018	EUR	4.632.107	USD	5.760.108	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(54.807)
	19.04.2018	EUR	112.941	USD	140.431	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.324)
	19.04.2018	EUR	459.754	USD	571.660	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.388)
	19.04.2018	EUR	113.858	USD	141.572	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.334)
	19.04.2018	EUR	532.855	USD	660.441	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.131)
	19.04.2018	EUR	231.889	USD	287.413	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.798)
	19.04.2018	EUR	76.751	USD	94.891	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(359)
	19.04.2018	EUR	117.616	USD	145.415	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(549)
	19.04.2018	EUR	128.609	USD	159.007	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(601)
	19.04.2018	EUR	35.438	USD	43.813	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(166)
	19.04.2018	EUR	364.135	USD	447.855	Absicherung	JP Morgan Chase New York	645
	19.04.2018	EUR	263.043	USD	323.520	Absicherung	JP Morgan Chase New York	466
	19.04.2018	EUR	9.985	USD	12.281	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	04.04.2018	HKD	910.800	USD	116.055	Handel	Citibank	23
	01.06.2018	NOK	69.049.352	EUR	7.136.377	Handel	Royal Bank of Scotland	(5.423)
	01.06.2018	NOK	131.809	EUR	13.623	Handel	Royal Bank of Scotland	(10)
	04.04.2018	SGD	26.090	USD	19.900	Handel	Royal Bank of Scotland	(1)
	19.04.2018	USD	4.786	EUR	3.887	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2018	USD	27.161	EUR	22.063	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.04.2018	USD	15.745	EUR	12.739	Absicherung	JP Morgan Chase New York	54
	23.04.2018	USD	68.951.865	EUR	56.019.668	Handel	Royal Bank of Scotland	(66.433)
	23.04.2018	USD	19.641.165	GBP	14.011.111	Handel	JP Morgan	(34.462)
	23.04.2018	USD	7.692.710	MXN	145.310.749	Handel	Goldman Sachs	(238.533)
	23.04.2018	USD	248.477	EUR	200.000	Handel	HSBC	2.066
	19.04.2018	USD	7.115	EUR	5.740	Absicherung	JP Morgan Chase New York	44
	03.04.2018	USD	330.591	MXN	6.044.160	Handel	Royal Bank of Scotland	(297)
	04.04.2018	USD	58.607	ZAR	695.250	Handel	Credit Suisse	(19)
	23.04.2018	USD	738.865	EUR	600.000	Handel	Royal Bank of Scotland	(358)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income (Fortsetzung)								
	23.04.2018	USD	124.658	EUR	100.000	Handel	HSBC	1.452
	19.04.2018	USD	720.736	EUR	580.841	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.314
	03.04.2018	USD	37.330	ZAR	436.450	Handel	Royal Bank of Scotland	521
	03.04.2018	EUR	423.340	USD	524.565	Handel	Lloyds	(3.751)
	19.04.2018	EUR	149.171	USD	184.888	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.157)
	19.04.2018	EUR	98.548	USD	121.741	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(362)
	19.04.2018	EUR	321.403	USD	397.048	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.180)
	19.04.2018	EUR	129.961	USD	160.548	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(477)
	19.04.2018	EUR	154.934	USD	191.399	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(569)
	19.04.2018	EUR	540.169	USD	665.000	Absicherung	JP Morgan Chase New York	319
	19.04.2018	EUR	113.626	USD	139.884	Absicherung	JP Morgan Chase New York	67
	19.04.2018	EUR	120.511	USD	148.361	Absicherung	JP Morgan Chase New York	71
	19.04.2018	EUR	281.401	USD	345.857	Absicherung	JP Morgan Chase New York	741
	19.04.2018	EUR	123.597	USD	151.907	Absicherung	JP Morgan Chase New York	326
	19.04.2018	EUR	890.510	USD	1.094.482	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.346
	19.04.2018	EUR	53.598	USD	66.099	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(83)
	19.04.2018	EUR	380.908	USD	469.749	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(589)
	19.04.2018	EUR	140.652	USD	173.457	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(218)
								USD (2.642.199)
Threadneedle (Lux) - Global Focus								
	19.04.2018	EUR	2.544	USD	3.171	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(37)
	19.04.2018	EUR	28.978	USD	36.114	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(422)
	19.04.2018	EUR	4.583	USD	5.674	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(29)
	19.04.2018	EUR	62.595	USD	77.498	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(401)
	19.04.2018	EUR	2.885	USD	3.558	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2018	EUR	4.387	USD	5.410	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	19.04.2018	EUR	5.000	USD	6.145	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2018	EUR	76.300	USD	93.776	Absicherung	JP Morgan Chase New York	201
	19.04.2018	EUR	12.313	USD	15.144	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	19.04.2018	EUR	30.813	USD	37.898	Absicherung	JP Morgan Chase New York	55
	19.04.2018	EUR	19.990	USD	24.707	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(85)
	19.04.2018	EUR	41.497	USD	51.087	Absicherung	JP Morgan Chase New York	25
	19.04.2018	EUR	5.140	USD	6.350	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	19.04.2018	EUR	1.423	USD	1.764	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.04.2018	EUR	20.039	USD	24.837	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(155)
	19.04.2018	EUR	1.972.326	USD	2.452.622	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23.337)
	19.04.2018	USD	44.924	EUR	36.491	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.04.2018	USD	27.323	EUR	22.118	Absicherung	JP Morgan Chase New York	81
	19.04.2018	USD	1.558	EUR	1.253	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
	19.04.2018	EUR	118	USD	146	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2018	EUR	6.694	USD	8.276	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(31)
	19.04.2018	EUR	20.154.727	USD	25.062.765	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(238.471)
	19.04.2018	USD	21.097	EUR	17.069	Absicherung	JP Morgan Chase New York	73
	19.04.2018	EUR	10.140	USD	12.582	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(93)
	19.04.2018	EUR	18.850	USD	23.390	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(173)
								USD (262.813)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities								
	19.04.2018	EUR	24.985	USD	31.003	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(229)
	19.04.2018	EUR	1.995	USD	2.486	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(29)
	19.04.2018	EUR	287	USD	353	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	113.202	USD	140.768	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.339)
	19.04.2018	EUR	389.710	USD	484.612	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.610)
	19.04.2018	EUR	234.521	USD	291.631	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.775)
	19.04.2018	USD	7.873	EUR	6.335	Absicherung	JP Morgan Chase New York	70
	19.04.2018	USD	27.305	EUR	21.971	Absicherung	JP Morgan Chase New York	243
	19.04.2018	USD	16.391	EUR	13.189	Absicherung	JP Morgan Chase New York	146
	19.04.2018	USD	22	EUR	18	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								USD (8.523)
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies								
	19.04.2018	GBP	6.062.270	EUR	6.827.366	Absicherung	JP Morgan Chase New York	83.270
	19.04.2018	GBP	114.503	EUR	128.954	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.573
	19.04.2018	GBP	1.562.635	EUR	1.759.849	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21.463
	19.04.2018	GBP	105.456	EUR	118.765	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.449
	19.04.2018	GBP	3.984.855	EUR	4.553.407	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10.903)
	19.04.2018	GBP	837.999	EUR	957.563	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.293)
	19.04.2018	GBP	3.926.745	EUR	4.492.791	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16.530)
	19.04.2018	GBP	833.352	EUR	953.481	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.508)
	03.04.2018	DKK	430.890	USD	72.017	Handel	JP Morgan	(733)
	19.04.2018	GBP	6.381	EUR	7.303	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(28)
	19.04.2018	GBP	1.995	EUR	2.256	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
								EUR 73.778
Threadneedle (Lux) - American								
	19.04.2018	USD	3.414	EUR	2.763	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.04.2018	USD	4.346	EUR	3.506	Absicherung	JP Morgan Chase New York	27
	19.04.2018	USD	11.907	EUR	9.576	Absicherung	JP Morgan Chase New York	112
	19.04.2018	USD	18.651	EUR	15.000	Absicherung	JP Morgan Chase New York	176
	19.04.2018	USD	26.747	EUR	21.511	Absicherung	JP Morgan Chase New York	252
	19.04.2018	USD	510.414	EUR	411.342	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.764
	19.04.2018	USD	19.817	EUR	16.006	Absicherung	JP Morgan Chase New York	102
	19.04.2018	USD	59.397	EUR	47.975	Absicherung	JP Morgan Chase New York	307
	19.04.2018	USD	1.931.118	EUR	1.553.863	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17.221
	19.04.2018	USD	93.420	EUR	75.884	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(45)
	19.04.2018	USD	364.656	EUR	295.043	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.254
	19.04.2018	USD	32.961	EUR	26.800	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(47)
	19.04.2018	USD	36.442	EUR	29.629	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(52)
	19.04.2018	USD	19.540	EUR	15.887	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(28)
	19.04.2018	USD	24.391	EUR	19.845	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(52)
	19.04.2018	USD	3.493	EUR	2.833	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.04.2018	USD	373.000	EUR	300.133	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.326
	19.04.2018	EUR	32.569	USD	40.030	Absicherung	JP Morgan Chase New York	86

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - American <i>(Fortsetzung)</i>								
	19.04.2018	EUR	9.003	USD	11.065	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24
	19.04.2018	EUR	344.473	USD	424.815	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(533)
	19.04.2018	EUR	10.200	USD	12.712	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(148)
	19.04.2018	EUR	57.114	USD	71.177	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(831)
	19.04.2018	EUR	40.000	USD	49.634	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(367)
	19.04.2018	EUR	15.471	USD	19.128	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(72)
	19.04.2018	EUR	98	USD	121	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	4.715.421	USD	5.863.711	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(55.794)
	19.04.2018	EUR	2.523.109	USD	3.137.531	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(29.853)
	19.04.2018	EUR	24.242.966	USD	30.146.563	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(286.844)
	19.04.2018	EUR	10.419	USD	12.872	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(38)
	19.04.2018	EUR	42.253	USD	52.017	Absicherung	JP Morgan Chase New York	25
	19.04.2018	EUR	14.990	USD	18.527	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(64)
	19.04.2018	EUR	111.122	USD	137.341	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(473)
	19.04.2018	USD	198.766	EUR	159.936	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.772
	19.04.2018	USD	37.078	EUR	29.990	Absicherung	JP Morgan Chase New York	140
								USD (346.639)
Threadneedle (Lux) - American Select								
	19.04.2018	EUR	1.629	USD	2.014	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.04.2018	EUR	83	USD	103	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2018	EUR	23.724	USD	29.258	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(37)
	19.04.2018	EUR	945	USD	1.168	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2018	EUR	150	USD	185	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	110.380	USD	137.259	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.306)
	19.04.2018	EUR	288.305	USD	358.513	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.411)
	19.04.2018	EUR	646.636	USD	804.104	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7.651)
	19.04.2018	USD	1.405	EUR	1.132	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.04.2018	USD	9.291	EUR	7.476	Absicherung	JP Morgan Chase New York	83
	19.04.2018	USD	24.035	EUR	19.339	Absicherung	JP Morgan Chase New York	214
	19.04.2018	USD	55.231	EUR	44.442	Absicherung	JP Morgan Chase New York	493
	19.04.2018	USD	1.682	EUR	1.362	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.04.2018	USD	5.519	EUR	4.438	Absicherung	JP Morgan Chase New York	52
								USD (11.561)
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity								
	04.04.2018	AUD	1.986.249	USD	1.526.672	Handel	JP Morgan Chase New York	(3.152)
	19.04.2018	SGD	8.001	USD	6.102	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2018	SGD	19.840	USD	15.166	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(28)
	19.04.2018	SGD	6.664	USD	5.088	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2018	EUR	5.471	USD	6.804	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(65)
	19.04.2018	SGD	9.894	USD	7.553	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2018	SGD	898.406	USD	685.825	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(351)
	04.04.2018	HKD	2.760.299	USD	351.722	Handel	Citibank	70
	19.04.2018	SGD	6.536	USD	4.991	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2018	SGD	1.363	USD	1.041	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity (Fortsetzung)								
	19.04.2018	SGD	1.111	USD	848	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	SGD	14.370	USD	10.944	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20
	19.04.2018	USD	420	SGD	550	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	USD	38.949	SGD	51.023	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.04.2018	USD	17.380	SGD	22.889	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(84)
	19.04.2018	USD	382	EUR	307	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.04.2018	SGD	1.106	USD	839	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.04.2018	SGD	558	USD	423	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
								USD (3.572)
Threadneedle (Lux) - Asian Focus								
	19.04.2018	EUR	5.207	USD	6.475	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(62)
	19.04.2018	EUR	5.567	USD	6.923	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(66)
	04.04.2018	HKD	569.399	USD	72.554	Handel	Citibank	15
	19.04.2018	SGD	698.224	USD	533.010	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(273)
	19.04.2018	SGD	10.083	USD	7.697	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2018	SGD	7.974	USD	6.095	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.04.2018	SGD	3.524	USD	2.675	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14
	19.04.2018	SGD	3.806	USD	2.890	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14
	19.04.2018	SGD	38.345	USD	29.205	Absicherung	JP Morgan Chase New York	52
	19.04.2018	SGD	10.000	USD	7.636	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.04.2018	USD	26.328	SGD	34.484	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	19.04.2018	USD	29.432	SGD	38.755	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(138)
	19.04.2018	USD	262	SGD	345	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2018	USD	405	EUR	325	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.04.2018	USD	3.616	SGD	4.738	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2018	USD	28.685	SGD	37.577	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14
	19.04.2018	USD	381	EUR	306	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.04.2018	USD	447	SGD	585	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								USD (426)
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income								
	19.04.2018	USD	21.578	SGD	28.256	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	19.04.2018	SGD	154	USD	118	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	AUD	28.756	USD	22.651	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(594)
	19.04.2018	SGD	99.988	USD	76.264	Absicherung	JP Morgan Chase New York	26
	19.04.2018	AUD	199.505	USD	155.925	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.896)
	19.04.2018	SGD	16.626.969	USD	12.692.684	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.487)
	19.04.2018	SGD	4.764.436	USD	3.637.073	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.859)
	19.04.2018	SGD	9.224	USD	7.041	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2018	EUR	274.761	USD	341.670	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.251)
	19.04.2018	AUD	2.674.023	USD	2.107.318	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(56.214)
	19.04.2018	AUD	1.191.077	USD	938.652	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(25.039)
	19.04.2018	SGD	107.570	USD	82.130	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(55)
	19.04.2018	AUD	7.059	USD	5.564	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(149)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income (Fortsetzung)								
	19.04.2018	EUR	9.353	USD	11.564	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
	19.04.2018	AUD	484	USD	371	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	04.04.2018	AUD	204.000	USD	156.796	Handel	Citibank	(322)
	19.04.2018	AUD	29.973	USD	23.064	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(73)
	19.04.2018	SGD	15.391	USD	11.722	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21
	19.04.2018	AUD	9	USD	7	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	162.211	USD	201.279	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.486)
	19.04.2018	SGD	29.754	USD	22.721	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	19.04.2018	USD	4.462	EUR	3.625	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2018	USD	122.972	SGD	161.926	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(576)
	19.04.2018	USD	5.183	SGD	6.824	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24)
	19.04.2018	USD	119.931	SGD	158.011	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(630)
	19.04.2018	USD	12.667	SGD	16.682	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(61)
	19.04.2018	USD	93.652	SGD	122.661	Absicherung	JP Morgan Chase New York	63
	19.04.2018	USD	93.839	SGD	123.512	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(399)
	19.04.2018	USD	416.094	SGD	547.669	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.771)
	19.04.2018	USD	159.166	SGD	209.036	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(326)
	19.04.2018	USD	813.587	SGD	1.065.804	Absicherung	JP Morgan Chase New York	390
	19.04.2018	USD	433	SGD	567	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	USD	20.877	EUR	16.798	Absicherung	JP Morgan Chase New York	186
	19.04.2018	USD	127.744	AUD	164.922	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.241
	19.04.2018	USD	71.495	AUD	92.303	Absicherung	JP Morgan Chase New York	694
	19.04.2018	USD	246.996	SGD	324.299	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(440)
	19.04.2018	USD	318.164	SGD	416.853	Absicherung	JP Morgan Chase New York	109
	19.04.2018	USD	69.326	SGD	90.831	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24
	19.04.2018	USD	0**	SGD	0**	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								USD (99.949)
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities								
	19.04.2018	USD	247.820	EUR	201.635	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(531)
	19.04.2018	USD	185	CHF	175	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2018	USD	74.243	CHF	70.318	Absicherung	JP Morgan Chase New York	685
	19.04.2018	USD	1.027.590	EUR	831.144	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.876
	19.04.2018	USD	24.385	EUR	19.696	Absicherung	JP Morgan Chase New York	126
	19.04.2018	USD	19.321.314	SGD	25.311.056	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9.252
	19.04.2018	USD	2.576	EUR	2.073	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23
	19.04.2018	USD	256	GBP	180	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.04.2018	USD	1.824.478	EUR	1.468.056	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16.270
	19.04.2018	USD	18.013	EUR	14.606	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23
	19.04.2018	USD	19.748	EUR	15.970	Absicherung	JP Morgan Chase New York	78
	19.04.2018	SGD	380.905.364	USD	290.775.223	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(148.619)
	19.04.2018	GBP	2.694	USD	3.771	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
	19.04.2018	EUR	4.986	USD	6.187	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(46)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities								
(Fortsetzung)	19.04.2018	EUR	21.724	USD	26.897	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(139)
	19.04.2018	EUR	10.504	USD	12.931	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.04.2018	EUR	27.362	USD	34.025	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(324)
	19.04.2018	EUR	21.854.000	USD	27.175.842	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(258.576)
	19.04.2018	EUR	436.940	USD	543.343	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.170)
	19.04.2018	CHF	2.605	USD	2.769	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(45)
	19.04.2018	CHF	70.318	USD	74.758	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.201)
								USD (384.296)
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities*								
	19.04.2018	EUR	2.028	USD	2.522	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
	19.04.2018	EUR	2.019	USD	2.511	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24)
	19.04.2018	EUR	2.023	USD	2.515	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24)
	19.04.2018	EUR	2.017	USD	2.508	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24)
	19.04.2018	CHF	1.859	USD	1.977	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(31)
	19.04.2018	EUR	2.027	USD	2.519	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24)
	19.04.2018	CHF	1.861	USD	1.979	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(31)
	19.04.2018	USD	160	EUR	129	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2018	USD	139	EUR	112	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2018	USD	140	EUR	112	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2018	USD	139	EUR	112	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2018	USD	139	EUR	112	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2018	USD	109	CHF	103	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2018	USD	109	CHF	103	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
								USD (174)
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities								
	19.04.2018	EUR	3.810	SGD	6.221	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43)
	19.04.2018	EUR	24.521	SGD	39.701	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(73)
	19.04.2018	EUR	48.706	SGD	78.973	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(215)
	19.04.2018	EUR	4.889	SGD	7.925	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21)
	19.04.2018	EUR	4.869	SGD	7.890	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	19.04.2018	EUR	37.204	SGD	60.218	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(99)
	19.04.2018	EUR	41.957	SGD	68.105	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(232)
	19.04.2018	EUR	41.217	SGD	66.996	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(285)
	19.04.2018	SGD	9.705.210	EUR	5.962.377	Absicherung	JP Morgan Chase New York	49.682
	19.04.2018	SGD	9.987	EUR	6.133	Absicherung	JP Morgan Chase New York	54
	19.04.2018	SGD	28.046	EUR	17.316	Absicherung	JP Morgan Chase New York	57
	19.04.2018	USD	571	EUR	458	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.04.2018	USD	2.472	EUR	1.988	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.04.2018	USD	2.639.794	EUR	2.122.843	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20.393
	19.04.2018	USD	954	EUR	767	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2018	USD	400	EUR	325	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	USD	2.975	EUR	2.407	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
								EUR 69.238

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	19.04.2018	EUR	12.235	SGD	19.803	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(33)
	19.04.2018	SGD	228.684	EUR	141.244	Absicherung	JP Morgan Chase New York	418
	19.04.2018	SGD	62.407	EUR	38.427	Absicherung	JP Morgan Chase New York	232
	19.04.2018	SGD	73.429	EUR	44.976	Absicherung	JP Morgan Chase New York	511
	19.04.2018	SGD	21.370.833	EUR	13.129.129	Absicherung	JP Morgan Chase New York	109.399
	19.04.2018	SGD	284.514	EUR	175.037	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.210
	19.04.2018	SGD	12.775	EUR	7.870	Absicherung	JP Morgan Chase New York	43
	19.04.2018	SGD	12.792	EUR	7.863	Absicherung	JP Morgan Chase New York	61
	19.04.2018	SGD	3.153	EUR	1.945	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	19.04.2018	SGD	73.413	EUR	45.327	Absicherung	JP Morgan Chase New York	150
	19.04.2018	SGD	23.933	EUR	14.760	Absicherung	JP Morgan Chase New York	65
	19.04.2018	SGD	8.338	EUR	5.120	Absicherung	JP Morgan Chase New York	45
	19.04.2018	EUR	3.077	SGD	4.987	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
								EUR 112.097
Threadneedle (Lux) - European Select	19.04.2018	EUR	26.819	GBP	23.790	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(301)
	19.04.2018	EUR	9.581	GBP	8.501	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(110)
	19.04.2018	GBP	4.422	EUR	5.001	Absicherung	JP Morgan Chase New York	39
	19.04.2018	GBP	32	EUR	36	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	GBP	23.742.699	EUR	26.739.170	Absicherung	JP Morgan Chase New York	326.130
	19.04.2018	GBP	35.708	EUR	40.215	Absicherung	JP Morgan Chase New York	491
	19.04.2018	USD	715.754	EUR	575.588	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.530
	19.04.2018	EUR	56.706	GBP	49.689	Absicherung	JP Morgan Chase New York	63
	19.04.2018	EUR	65.113	GBP	57.103	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.04.2018	EUR	46.052	GBP	40.302	Absicherung	JP Morgan Chase New York	110
	19.04.2018	EUR	85.390	GBP	74.631	Absicherung	JP Morgan Chase New York	314
	19.04.2018	EUR	3.885	GBP	3.395	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
	19.04.2018	EUR	369.856	GBP	322.828	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.854
	19.04.2018	EUR	35.679	GBP	31.268	Absicherung	JP Morgan Chase New York	35
	19.04.2018	EUR	66.970	GBP	58.900	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(173)
	19.04.2018	EUR	19.353	GBP	17.089	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(127)
								EUR 333.889
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	19.04.2018	EUR	5.029	USD	6.181	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2018	EUR	2.488	USD	3.080	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16)
	19.04.2018	EUR	2.733	USD	3.379	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.04.2018	EUR	400.724	USD	498.307	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.741)
	19.04.2018	EUR	452.736	USD	562.987	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.357)
	19.04.2018	EUR	1.185	USD	1.469	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.04.2018	EUR	299	USD	367	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	GBP	146.391	USD	204.967	Absicherung	JP Morgan Chase New York	574
	19.04.2018	USD	26.747	EUR	21.522	Absicherung	JP Morgan Chase New York	239
	19.04.2018	USD	29.714	EUR	23.909	Absicherung	JP Morgan Chase New York	265
	19.04.2018	USD	10.883	GBP	7.645	Absicherung	JP Morgan Chase New York	148
								USD (8.897)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux)- Greater China Equities								
	19.04.2018	USD	6.376	EUR	5.161	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	04.04.2018	USD	21.776	HKD	170.900	Handel	Citibank	(4)
	19.04.2018	USD	101.735	EUR	81.988	Absicherung	JP Morgan Chase New York	750
	19.04.2018	USD	1.292	EUR	1.037	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
	19.04.2018	USD	47.274	EUR	38.039	Absicherung	JP Morgan Chase New York	422
	19.04.2018	USD	16.846	EUR	13.555	Absicherung	JP Morgan Chase New York	150
	19.04.2018	USD	20.654	EUR	16.706	Absicherung	JP Morgan Chase New York	78
	19.04.2018	EUR	248.893	USD	309.503	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.945)
	19.04.2018	EUR	707.830	USD	880.198	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8.376)
								USD (9.891)
Threadneedle (Lux) - Global Technology								
	19.04.2018	EUR	269.207	USD	334.734	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.155)
	19.04.2018	EUR	2.631.553	USD	3.272.383	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(31.136)
	19.04.2018	EUR	15.898.880	USD	19.770.544	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(188.115)
	19.04.2018	EUR	117.225	USD	144.814	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(430)
	19.04.2018	EUR	5.270	USD	6.531	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(41)
	19.04.2018	EUR	265.154	USD	328.643	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.056)
	19.04.2018	EUR	254.050	USD	315.887	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.977)
	19.04.2018	CHF	1.212	USD	1.289	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21)
	19.04.2018	USD	1.619.213	EUR	1.302.891	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14.439
	19.04.2018	USD	720	EUR	584	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2018	USD	357	EUR	291	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2018	USD	1.772	EUR	1.433	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.04.2018	USD	114	EUR	92	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	USD	261.111	EUR	210.101	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.328
	19.04.2018	USD	513	EUR	415	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2018	USD	33.391	EUR	27.123	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16)
	19.04.2018	USD	94	CHF	89	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2018	EUR	312.818	USD	385.108	Absicherung	JP Morgan Chase New York	185
	19.04.2018	EUR	259.965	USD	320.597	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(402)
	19.04.2018	EUR	499.908	USD	614.413	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.317
	19.04.2018	EUR	6.291	USD	7.738	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
	19.04.2018	EUR	39.350	USD	48.397	Absicherung	JP Morgan Chase New York	70
	19.04.2018	EUR	403.408	USD	498.590	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.717)
	19.04.2018	EUR	163.184	USD	201.753	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(762)
	19.04.2018	EUR	14.356	USD	17.813	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(132)
	19.04.2018	EUR	213.536	USD	264.966	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.957)
	19.04.2018	EUR	145.216	USD	180.973	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.112)
	19.04.2018	EUR	41.988	USD	51.985	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(269)
	19.04.2018	EUR	486.267	USD	602.040	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.112)
								USD (220.051)
Threadneedle (Lux) - UK Equities								
	19.04.2018	GBP	121.826	USD	171.195	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(103)
	19.04.2018	CHF	977	GBP	743	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
	19.04.2018	EUR	982	GBP	861	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - UK Equities (Fortsetzung)								
	19.04.2018	EUR	4.279	GBP	3.763	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.04.2018	CHF	107.857	GBP	81.961	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.605)
	19.04.2018	EUR	8.213.492	GBP	7.293.063	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(87.878)
	19.04.2018	EUR	1.805.120	GBP	1.602.832	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19.313)
	19.04.2018	EUR	1.459.076	GBP	1.295.567	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15.610)
	19.04.2018	EUR	969	GBP	860	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.04.2018	EUR	476	GBP	422	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	19.04.2018	EUR	5.697	GBP	4.978	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.04.2018	EUR	4.930	GBP	4.309	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16
	19.04.2018	EUR	100	GBP	88	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	1.206	GBP	1.058	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	1.207	GBP	1.071	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
	19.04.2018	EUR	4.140	GBP	3.661	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(29)
	19.04.2018	EUR	836	GBP	739	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	19.04.2018	GBP	97.313	EUR	109.679	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.098
	19.04.2018	GBP	1.319	EUR	1.487	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
	19.04.2018	GBP	41.322	EUR	46.583	Absicherung	JP Morgan Chase New York	457
	19.04.2018	GBP	9.557	EUR	10.935	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(35)
	19.04.2018	GBP	2.055	EUR	2.351	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.04.2018	GBP	1.619	EUR	1.850	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2018	GBP	44.979	EUR	51.331	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(50)
	19.04.2018	GBP	193	EUR	220	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	GBP	131.677	EUR	149.123	Absicherung	JP Morgan Chase New York	860
	19.04.2018	GBP	176.247	EUR	200.394	Absicherung	JP Morgan Chase New York	453
	19.04.2018	GBP	12.540	EUR	14.258	Absicherung	JP Morgan Chase New York	32
	19.04.2018	GBP	36.048	EUR	41.134	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(36)
	19.04.2018	GBP	6.573	EUR	7.500	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	19.04.2018	GBP	57.054	EUR	65.365	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(287)
	19.04.2018	GBP	3.223	EUR	3.693	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16)
	19.04.2018	GBP	64.546	EUR	73.866	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(252)
	19.04.2018	USD	2.856.736	GBP	2.040.333	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.694)
								GBP (128.033)
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income								
	19.04.2018	USD	824.254	GBP	588.697	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.643)
	19.04.2018	USD	1.306	GBP	933	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2018	USD	17.422	GBP	12.470	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(61)
	19.04.2018	SGD	1.777	GBP	970	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2018	EUR	1.129	GBP	1.003	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
	19.04.2018	EUR	1.142	GBP	1.014	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
	19.04.2018	EUR	1.154	GBP	1.025	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
	19.04.2018	EUR	1.113	GBP	988	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
	19.04.2018	EUR	1.126	GBP	1.000	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
	19.04.2018	EUR	266.530	GBP	236.661	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.852)
	19.04.2018	EUR	2.446	GBP	2.170	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24)
	19.04.2018	CHF	125.134	GBP	95.090	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.862)
	19.04.2018	USD	990	GBP	707	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
								GBP (6.511)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha								
	19.04.2018	USD	5.723	EUR	4.630	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20
	19.04.2018	USD	998	EUR	811	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	USD	86.930	EUR	70.612	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
	19.04.2018	USD	9.813	EUR	7.944	Absicherung	JP Morgan Chase New York	29
	19.04.2018	USD	6.229	EUR	5.042	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	19.04.2018	USD	0**	EUR	0**	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	USD	150	GBP	107	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	USD	875.228	GBP	624.556	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.679)
	19.04.2018	USD	6.428	EUR	5.169	Absicherung	JP Morgan Chase New York	60
	19.04.2018	GBP	1.206.362	USD	1.702.133	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8.341)
	19.04.2018	GBP	1.000	USD	1.411	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	19.04.2018	GBP	3	USD	4	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	GBP	229.317	USD	321.074	Absicherung	JP Morgan Chase New York	898
	19.04.2018	GBP	41.570.066	USD	58.203.579	Absicherung	JP Morgan Chase New York	162.872
	19.04.2018	GBP	1.883.841	USD	2.637.627	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7.381
	19.04.2018	GBP	81.796.999	USD	114.526.598	Absicherung	JP Morgan Chase New York	320.480
	19.04.2018	EUR	307	USD	379	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2018	EUR	2.000	USD	2.476	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.04.2018	EUR	4.915	USD	6.040	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2018	EUR	9.578	USD	11.910	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(112)
	19.04.2018	EUR	5.533	USD	6.857	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43)
	19.04.2018	EUR	24.633.444	USD	30.632.131	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(291.464)
	19.04.2018	EUR	631.663	USD	785.484	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7.474)
	19.04.2018	EUR	1.450.912	USD	1.804.236	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17.167)
	19.04.2018	EUR	4.196	USD	5.207	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(38)
	19.04.2018	CHF	161.180	USD	171.357	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.753)
	19.04.2018	USD	30.996	GBP	21.769	Absicherung	JP Morgan Chase New York	431
	19.04.2018	USD	23.658	EUR	18.983	Absicherung	JP Morgan Chase New York	276
	19.04.2018	USD	8.833	EUR	7.134	Absicherung	JP Morgan Chase New York	46
	19.04.2018	USD	35.084	EUR	28.449	Absicherung	JP Morgan Chase New York	44
	19.04.2018	USD	16.204	EUR	13.175	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
								USD 163.411
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia								
	19.04.2018	EUR	934	USD	1.162	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.04.2018	EUR	10.529	USD	13.093	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(125)
	19.04.2018	EUR	946	USD	1.176	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.04.2018	AUD	1.010	USD	796	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21)
	09.04.2018	AUD	272.400	USD	211.587	Handel	Deutsche Bank	(2.646)
	09.04.2018	CAD	54.000	USD	41.791	Handel	Goldman Sachs	102
	09.04.2018	CAD	352.000	USD	274.447	Handel	Goldman Sachs	(1.362)
	19.04.2018	CHF	424.195	USD	450.978	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7.246)
	19.04.2018	EUR	965	USD	1.201	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.04.2018	EUR	1.018	USD	1.266	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
	09.04.2018	EUR	656.000	USD	802.884	Handel	Deutsche Bank	4.523
	19.04.2018	EUR	15.709.576	USD	19.535.141	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(185.877)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2018	GBP	1.027	USD	1.438	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	09.04.2018	GBP	201.000	USD	283.408	Handel	Deutsche Bank	(1.315)
	19.04.2018	GBP	982	USD	1.375	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	09.04.2018	JPY	13.704.000	USD	130.185	Handel	Goldman Sachs	(1.238)
	09.04.2018	JPY	65.902.000	USD	619.718	Handel	Goldman Sachs	382
	19.04.2018	SGD	995	USD	759	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	09.04.2018	USD	165.027	EUR	134.000	Handel	Deutsche Bank	99
	09.04.2018	USD	1.009.727	EUR	816.000	Handel	Deutsche Bank	5.387
	09.04.2018	USD	213.658	AUD	272.400	Handel	Deutsche Bank	4.718
	09.04.2018	USD	1.131.300	JPY	121.292.000	Handel	Goldman Sachs	(9.982)
	09.04.2018	USD	2.079.002	CAD	2.633.000	Handel	Goldman Sachs	36.284
								USD (158.354)
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities*								
	19.04.2018	USD	2.000	EUR	1.611	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
	19.04.2018	GBP	1.408	EUR	1.606	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	USD	2.000	EUR	1.612	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	19.04.2018	GBP	1.408	EUR	1.606	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	USD	2.000	EUR	1.612	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	19.04.2018	CHF	1.892	EUR	1.610	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2018	USD	2.000	EUR	1.612	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	19.04.2018	USD	2.000	EUR	1.612	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	19.04.2018	GBP	1.408	EUR	1.606	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	GBP	1.408	EUR	1.606	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	GBP	1.408	EUR	1.606	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	30.04.2018	EUR	145.001	USD	178.999	Handel	JP Morgan	(215)
	30.04.2018	EUR	244.436	GBP	213.999	Handel	JP Morgan	568
	19.04.2018	CHF	1.892	EUR	1.610	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
								EUR 406
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond								
	19.04.2018	USD	54.402	EUR	44.190	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(26)
	19.04.2018	USD	117.241	EUR	94.696	Absicherung	JP Morgan Chase New York	605
	19.04.2018	USD	5.394	EUR	4.329	Absicherung	JP Morgan Chase New York	63
	06.04.2018	USD	131.854	EUR	106.163	Handel	Royal Bank of Scotland	1.215
	19.04.2018	USD	23.346	EUR	18.814	Absicherung	JP Morgan Chase New York	172
	06.04.2018	USD	1.997.684	RUB	112.209.920	Handel	HSBC	46.472
	06.04.2018	USD	2.177.760	AUD	2.789.793	Handel	HSBC	37.904
	06.04.2018	USD	5.731	CAD	7.323	Handel	HSBC	50
	06.04.2018	USD	4.433	CHF	4.167	Handel	JP Morgan	79
	06.04.2018	USD	1.546.657	EUR	1.262.074	Handel	UBS AG Stamford Branch	(6.370)
	06.04.2018	USD	24.351	GBP	17.598	Handel	HSBC	(344)
	06.04.2018	USD	1.980	JPY	211.379	Handel	Royal Bank of Scotland	(8)
	19.04.2018	EUR	10.240	USD	12.650	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(38)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond								
(Fortsetzung)	06.04.2018	EUR	458.817	SEK	4.679.372	Handel	HSBC	5.535
	19.04.2018	EUR	11.995	USD	14.949	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(174)
	06.04.2018	EUR	20.134	SEK	203.434	Handel	Royal Bank of Scotland	470
	06.04.2018	EUR	462.455	SEK	4.693.783	Handel	Royal Bank of Scotland	8.288
	19.04.2018	EUR	813.133	USD	1.011.145	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9.621)
	19.04.2018	EUR	1.604.863	USD	1.995.677	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18.989)
	19.04.2018	EUR	582.134	USD	723.894	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6.888)
	06.04.2018	EUR	96.611	USD	119.757	Handel	UBS AG Stamford Branch	(873)
	19.04.2018	GBP	1.235.302	USD	1.729.586	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.840
	19.04.2018	GBP	11.921	USD	16.691	Absicherung	JP Morgan Chase New York	47
	06.04.2018	JPY	30.192.822	USD	287.317	Handel	Barclays Capital	(3.273)
	06.04.2018	NOK	4.309.941	SEK	4.519.538	Handel	HSBC	9.140
	06.04.2018	USD	4.652	MXN	87.991	Handel	HSBC	(163)
	06.04.2018	USD	2.142	NZD	2.968	Handel	HSBC	1
	06.04.2018	USD	770.875	ZAR	9.093.302	Handel	Goldman Sachs	4.342
	06.04.2018	USD	55.959	EUR	45.434	Handel	UBS AG Stamford Branch	50
	06.04.2018	USD	284.869	JPY	30.239.444	Handel	HSBC	386
	06.04.2018	NOK	4.602.506	USD	586.211	Handel	Goldman Sachs	167
	06.04.2018	SEK	14.062.664	USD	1.707.144	Handel	Barclays Capital	(27.050)
	06.04.2018	USD	31.489	NOK	242.296	Handel	Goldman Sachs	619
								USD 46.628
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha								
	19.04.2018	GBP	2.038	EUR	2.295	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28
	19.04.2018	GBP	35.783.652	EUR	40.299.764	Absicherung	JP Morgan Chase New York	491.523
	19.04.2018	GBP	2.034	EUR	2.291	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28
	19.04.2018	GBP	409.902	EUR	467.787	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(522)
	19.04.2018	USD	2.043	EUR	1.643	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16
								EUR 491.073
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities								
	19.04.2018	USD	8.651	GBP	6.164	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2018	USD	25.800	GBP	18.360	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	19.04.2018	USD	204	EUR	165	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2018	USD	15.887	EUR	12.883	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20
	19.04.2018	USD	10.687	EUR	8.613	Absicherung	JP Morgan Chase New York	79
	19.04.2018	USD	3.718	EUR	2.984	Absicherung	JP Morgan Chase New York	43
	19.04.2018	USD	15	EUR	12	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	USD	28.447	EUR	22.951	Absicherung	JP Morgan Chase New York	178
	19.04.2018	USD	21.331	EUR	17.356	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(46)
	19.04.2018	SGD	344	USD	263	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	10.024	USD	12.384	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(37)
	19.04.2018	CHF	1.848	USD	1.950	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
	19.04.2018	EUR	100	USD	123	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	100	USD	123	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	10.071	USD	12.447	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43)
	19.04.2018	EUR	3.648.070	USD	4.536.440	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43.164)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN / (-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities (Fortsetzung)								
	19.04.2018	SGD	900.253	USD	687.235	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(351)
	19.04.2018	SGD	4.000	USD	3.055	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2018	EUR	1.900	USD	2.349	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.04.2018	EUR	548	USD	677	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2018	EUR	200	USD	247	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2018	CHF	132	USD	140	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2018	GBP	10	USD	14	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	500	USD	617	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2018	CHF	795	USD	839	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.04.2018	CHF	39	USD	41	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2018	GBP	3.361.021	USD	4.705.873	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13.168
	19.04.2018	GBP	71.747.428	USD	100.455.871	Absicherung	JP Morgan Chase New York	281.107
	19.04.2018	CHF	257.588	USD	273.851	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.400)
	19.04.2018	EUR	15.460.479	USD	19.225.384	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(182.927)
	19.04.2018	EUR	2.579.244	USD	3.207.336	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(30.518)
	19.04.2018	GBP	599.886	USD	839.919	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.350
	19.04.2018	CHF	1.319.358	USD	1.402.660	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22.538)
	19.04.2018	CHF	329	USD	347	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2018	EUR	690	USD	853	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2018	GBP	43.231	USD	60.272	Absicherung	JP Morgan Chase New York	426
	19.04.2018	EUR	66	USD	81	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	146	USD	180	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	EUR	1.221	USD	1.508	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2018	EUR	45	USD	56	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2018	GBP	87.045	USD	121.981	Absicherung	JP Morgan Chase New York	234
	19.04.2018	GBP	1.115.791	USD	1.563.625	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.001
	19.04.2018	CHF	306.862	USD	326.237	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.242)
	19.04.2018	EUR	5.218.548	USD	6.489.358	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(61.745)
	19.04.2018	SEK	997.079.386	USD	121.768.031	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.535.284)
	19.04.2018	USD	9.254	GBP	6.558	Absicherung	JP Morgan Chase New York	45
	19.04.2018	USD	5.926	SGD	7.800	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(25)
	19.04.2018	USD	609	GBP	431	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.04.2018	USD	15.283	GBP	10.801	Absicherung	JP Morgan Chase New York	118
	19.04.2018	USD	43.712	GBP	30.859	Absicherung	JP Morgan Chase New York	384
	19.04.2018	USD	12.717	GBP	8.932	Absicherung	JP Morgan Chase New York	177
	19.04.2018	USD	1.798	GBP	1.263	Absicherung	JP Morgan Chase New York	25
	19.04.2018	USD	7.915	GBP	5.588	Absicherung	JP Morgan Chase New York	70
	19.04.2018	USD	56.855	GBP	40.780	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(402)
	19.04.2018	USD	6.725	SGD	8.855	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(31)
	19.04.2018	USD	5.270	GBP	3.772	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(26)
	19.04.2018	USD	252.455	GBP	180.687	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.238)
	19.04.2018	USD	2.607	GBP	1.852	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2018	USD	2.436	SGD	3.208	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
	19.04.2018	USD	28.335	GBP	20.123	Absicherung	JP Morgan Chase New York	81
	19.04.2018	USD	5.592	GBP	3.985	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
								USD (2.586.552)

*Siehe Erläuterung 1.

**Bruchbetrag gerundet auf 0.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

Zum 31. März 2018 hielt Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond die folgenden offenen Zinsswaps:

Beschreibung	Kontrahent	Bezahlen	Erhalten	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter (Verlust) im Portfolio Basiswährung	% des Nettovermögens
IRS	Citigroup Global Markets	5,45 %	COP-IBR-OIS-COMPOUND	COP	3.246.562.886	10.07.2022	(15.249)	(0,09)
IRS	Citigroup Global Markets	5,41 %	COP-IBRCOL-COMPOUND	COP	2.824.527.634	14.02.2023	(7.266)	(0,04)
							USD (22.515)	(0,13)

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/ Verkauf:	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Marktwert USD	% des Nettovermögens
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 24	Kaufen	EUR	750.000	20.06.2021	(19.992)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Metro AG 20/06/2021	Kaufen	EUR	100.000	20.06.2021	(1.831)	0,00
CDS	JPMorgan	RWE Finance II 20/06/2021	Kaufen	EUR	260.000	20.06.2021	(8.331)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kaufen	EUR	55.000	20.06.2022	(4.020)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kaufen	EUR	55.000	20.06.2022	(4.020)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kaufen	EUR	60.000	20.06.2022	(4.386)	0,00
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kaufen	EUR	80.000	20.06.2022	(5.848)	0,00
CDS	Barclays	PostNL NV 20/12/2020	Kaufen	EUR	50.000	20.12.2020	(1.211)	0,00
CDS	Barclays	Metro AG 20/06/2021	Kaufen	EUR	75.000	20.06.2021	(1.374)	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kaufen	EUR	74.000	20.06.2022	(4.135)	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kaufen	EUR	150.000	20.06.2022	(8.381)	(0,02)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kaufen	EUR	295.000	20.06.2022	(16.482)	(0,02)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kaufen	EUR	185.000	20.06.2022	(10.336)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kaufen	EUR	146.000	20.06.2022	(8.157)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	PostNL NV 20/12/2020	Kaufen	EUR	80.000	20.12.2020	(1.937)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Pearson plc 20/09/2020	Kaufen	EUR	225.000	20.09.2020	(5.332)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Metro AG 20/06/2021	Kaufen	EUR	165.000	20.06.2021	(3.022)	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	ITRAXX Europe Crossover	Kaufen	EUR	5.650.000	20.06.2023	(703.810)	(0,49)
CDS	Goldman Sachs	PostNL NV 20/12/2020	Kaufen	EUR	58.000	20.12.2020	(1.405)	0,00
CDS	Goldman Sachs	Tesco plc 20/06/2021	Kaufen	EUR	200.000	20.06.2021	(2.642)	0,00
							USD (816.652)	(0,57)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/ Verkauf:	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kaufen	EUR	61.000	20.06.2022	(2.771)	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kaufen	EUR	120.000	20.06.2022	(5.452)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kaufen	EUR	245.000	20.06.2022	(11.130)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kaufen	EUR	150.000	20.06.2022	(6.814)	(0,01)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kaufen	EUR	124.000	20.06.2022	(5.633)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kaufen	EUR	165.000	20.06.2022	(9.807)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kaufen	EUR	165.000	20.06.2022	(9.807)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kaufen	EUR	165.000	20.06.2022	(9.807)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kaufen	EUR	235.000	20.06.2022	(13.967)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Pizza Express Financing PLC	Kaufen	EUR	60.000	20.06.2023	11.836	0,01
CDS	Citigroup Global Markets	Pizza Express Financing PLC	Kaufen	EUR	150.000	20.06.2023	29.591	0,04
CDS	Citigroup Global Markets	ITRAXX Europe Crossover Series 21	Kaufen	EUR	3.500.000	20.06.2023	(354.505)	(0,42)
							EUR (388.266)	(0,46)

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond* die folgenden ausstehenden Zinsswap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Bezahlen	Erhalten	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter (Verlust) im Portfolio Basiswährung	% des Netto- vermögens
IRS	Citigroup Global Markets	3M LIBOR	2,003 %	KRW	2.000.000.000	26.03.2020	(155)	0,00
							USD (155)	0,00

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/ Verkauf:	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Crossover Series 21	Verkaufen	EUR	1.000.000	20.06.2022	143.868	0,20
							USD 143.868	0,20

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Bezahlen/Erhalten	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn / (Verlust) im Portfolio Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	Bank of America Merrill Lynch	North America Equity Basket	Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 6 Aktien und Zahlung des US-1M-LIBOR +0,30 %.	USD	13.428.738	20.09.2019	(372.143)	(0,17)
TRS	Bank of America Merrill Lynch	North America Equity Basket	Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 39 Aktien und Erhalt von US-1M-LIBOR.	USD	51.222.435	20.09.2019	2.200.047	0,99
							USD 1.827.904	0,82

Zum 31. März 2018 hatte das Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Bezahlen/Erhalten	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn / (Verlust) im Portfolio Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	Barclays	North America Commodities Basket	Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 16 Index und Zahlung von 0,15 % bis 0,60 %.	USD	32.438.003	30.11.2018	(4.919)	(0,01)
TRS	Goldman Sachs	North America Commodities Basket	Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 47 Index und Zahlung von -0,26 % bis -0,02 %.	USD	136.786.411	05.12.2018	111.314	0,31
TRS	Deutsche Bank	North America Commodities Basket	Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 10 Indizes und Zahlung von 0 %.	USD	22.837.175	29.03.2018	291.046	0,82
TRS	JPMorgan	North America Commodities Basket	Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 6 Indizes und Zahlung von -0,15 % bis 0 %.	USD	24.073.449	04.12.2018	(90.210)	(0,25)
TRS	Citigroup Global Markets	North America Commodities Basket	Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 11 Indizes und Zahlung von 0 % bis 0,40 %.	USD	37.637.503	30.11.2018	(191.955)	(0,54)
TRS	Morgan Stanley	North America Commodities Basket	Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 7 Index und Zahlung von -0,20 % bis -0,15 %.	USD	32.321.509	05.12.2018	(34.158)	(0,10)
							USD 81.118	0,23

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Zum 31. März 2018 hielt Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities* die folgenden offenen Kreditausfallswaps:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/ Verkauf:	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
CDS	JPMorgan	Tesco plc 20/06/2023	Kaufen	GBP	60.000	20.06.2023	1.176	0,03
							EUR 1.176	0,03

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/ Verkauf:	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
CDS	Citigroup Global Markets	Markit CDX.NA.HY.29 Index	Verkaufen	USD	2.100.000	20.12.2022	38.960	0,35
CDS	Citigroup Global Markets	Markit ITRX.Europe	Verkaufen	EUR	4.700.000	20.12.2022	132.797	1,20
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Europe Crossover Series 21	Kaufen	EUR	508.000	20.12.2021	(70.210)	(0,64)
CDS	HSBC	ITRAXX Europe Crossover Series 24	Kaufen	EUR	1.300.000	20.06.2021	(34.651)	(0,31)
							USD 66.896	0,60

Zum 31. März 2018 hielt Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond die folgenden offenen Zinsswaps:

Beschreibung	Kontrahent	Bezahlen	Erhalten	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter (Verlust) im Portfolio Basiswährung	% des Netto- vermögens
IRS	Citigroup Global Markets	5,45 %	COP- IBR-OIS- COMPOUND	COP	3.214.128.608	10.07.2022	(15.097)	(0,14)
IRS	Citigroup Global Markets	5,41 %	COP-IBRCOL- COMPOUND	COP	1.032.195.258	14.02.2023	(2.656)	(0,02)
							USD (17.753)	(0,16)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Bezahlen/Erhalten	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter (Verlust) im Portfolio Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	Goldman Sachs	North America Equity Basket	Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 6 Aktien und Erhalt 1M-TOIS -0,40 %.	CHF	2.363.442	24.03.2028	(37.257)	(0,08)
TRS	Goldman Sachs	North America Equity Basket	Zahlung der Performance der 5 zugrunde liegenden Aktien und Erhalt von DKDRA -0,40 %.	DKK	17.717.911	02.02.2028	(34.780)	(0,08)
TRS	Goldman Sachs	North America Equity Basket	Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 8 Aktien und Zahlung von 1M-EURIBOR +0,40 %. Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 43 Aktien und Erhalt von 1M-EONIA -0,40 % bis -3 %.	EUR	29.091.715	23.02.2028	(59.547)	(0,13)
TRS	Goldman Sachs	North America Equity Basket	Erhalt der Performance der 2 zugrunde liegenden Aktien und Zahlung von 1M-LIBOR +0,40 %. Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 7 Aktien und Erhalt von 1M-SONIA -0,40 %.	GBP	3.426.876	15.09.2027	(89.109)	(0,20)
TRS	Goldman Sachs	North America Equity Basket	Zahlung der Performance Aktien und Erhalt von NKDRA -0,40 %.	NOK	249.163	18.08.2027	(234)	0,00
TRS	Goldman Sachs	North America Equity Basket	Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 5 Aktien und Erhalt von 1M-STIBOR -0,40 %.	SEK	25.002.886	26.01.2028	(50.302)	(0,11)
							EUR (271.229)	(0,60)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Bezahlen/Erhalten	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter (Verlust) im Portfolio Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	Citigroup Global Markets	North America Commodities Basket	Erhalt der Performance BCOM BBG COMDTY Index und Zahlung von 0,11 %.	USD	59.749.451	29.03.2018	(452.828)	(0,08)
TRS	Credit Suisse	North America Commodities Basket	Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 3 Indizes und Zahlung von 0 % bis 0,25 %. Zahlung der Performance des zugrunde liegenden 2 Indizes.	USD	288.694.987	29.03.2018	(589.808)	(0,11)
TRS	Goldman Sachs	North America Commodities Basket	Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 4 BCOM BBG COMDTY Index und Zahlung von 0,11 %.	USD	154.540.759	29.03.2018	(1.156.525)	(0,21)
TRS	JPMorgan	North America Commodities Basket	Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 19 Indizes und Zahlung von 0 % bis 0,25 %. Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 13 Indizes.	USD	877.435.515	29.03.2018	(1.945.237)	(0,35)
TRS	Macquarie	North America Commodities Basket	Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 2 BCOM BBG COMDTY Index und Zahlung von 0,17 %.	USD	129.501.043	29.03.2018	(1.029.739)	(0,19)
							USD (5.174.137)	(0,94)

*Siehe Erläuterung 1.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

11 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

Zum 31. März 2018 ist die Gegenpartei von ausstehenden Terminkontrakten UBS.

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen im Portfolio Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn / (Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-Bobl Future	Verkauf	(15)	EUR	(2.421.267)	07.06.2018	(19.370)	(0,11)
Euro-Buxl Future	Kauf	5	EUR	1.016.963	07.06.2018	30.254	0,17
Euro-OAT Future	Verkauf	(10)	EUR	(1.901.225)	07.06.2018	(33.083)	(0,18)
Euro-Bund Future	Kauf	2	EUR	392.150	07.06.2018	5.928	0,03
3-Year Australian Treasury Bond Future	Kauf	43	AUD	3.666.863	15.06.2018	3.557	0,02
20-Year US Long Bond	Kauf	1	USD	146.625	20.06.2018	3.844	0,02
10-Year US Treasury Note Future	Kauf	7	USD	847.984	20.06.2018	3.828	0,02
US Ultra Bond	Kauf	12	USD	1.925.625	20.06.2018	57.375	0,33
Long Gilt Future	Verkauf	(2)	GBP	(344.584)	27.06.2018	(4.882)	(0,03)
2-Year US Treasury Note Future	Kauf	7	USD	1.488.266	29.06.2018	(328)	0,00
5-Year US Treasury Note Future	Kauf	23	USD	2.632.602	29.06.2018	7.367	0,04
						USD 54.490	0,31

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen im Portfolio Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn / (Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-Bund Future	Verkauf	(2)	EUR	(392.150)	07.06.2018	(3.321)	0,00
Euro-Bobl Future	Verkauf	(12)	EUR	(1.937.014)	07.06.2018	(15.939)	(0,01)
3-Year Australian Treasury Bond Future	Kauf	18	AUD	1.534.966	15.06.2018	2.976	0,00
20-Year US Long Bond	Verkauf	(7)	USD	(1.026.375)	20.06.2018	(23.953)	(0,02)
Canadian Dollar Future	Kauf	17	CAD	1.757.294	20.06.2018	29.009	0,02
10-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(9)	USD	(1.090.266)	20.06.2018	(8.086)	(0,01)
Long Gilt Future	Verkauf	(79)	GBP	(13.611.060)	27.06.2018	(189.476)	(0,12)
5-Year US Treasury Note Future	Kauf	19	USD	2.174.758	29.06.2018	6.086	0,00
						USD (202.704)	(0,14)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

11 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

(Fortsetzung)

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - European Social Bond* die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter (Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-Bobl Future	Verkauf	(7)	EUR	(918.750)	07.06.2018	(6.430)	(0,04)
Euro-Bund Future	Verkauf	(2)	EUR	(318.860)	07.06.2018	(5.460)	(0,04)
						EUR (11.890)	(0,08)

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-Bobl Future	Kauf	37	EUR	4.856.250	07.06.2018	24.580	0,03
Euro-OAT Future	Verkauf	(35)	EUR	(5.410.650)	07.06.2018	(94.150)	(0,11)
Mid-Term Euro-BTP Future	Verkauf	(29)	EUR	(4.024.910)	07.06.2018	(84.030)	(0,10)
Euro-Bund Future	Kauf	56	EUR	8.928.080	07.06.2018	132.560	0,16
Euro-Schatz Future	Verkauf	(58)	EUR	(6.494.550)	07.06.2018	(11.310)	(0,01)
Euro-Buxl Future	Kauf	18	EUR	2.976.840	07.06.2018	59.440	0,07
10-Year Australian Treasury Bond Future	Kauf	1	AUD	80.841	15.06.2018	(96)	0,00
20-Year US Long Bond	Verkauf	(2)	USD	(238.444)	20.06.2018	(6.276)	(0,01)
10-Year US Treasury Note Future	Kauf	55	USD	5.417.518	20.06.2018	35.211	0,04
10-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(11)	USD	(1.161.486)	20.06.2018	(16.980)	(0,02)
Long Gilt Future	Verkauf	(67)	GBP	(9.386.151)	27.06.2018	(128.480)	(0,15)
5-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(54)	USD	(5.025.727)	29.06.2018	(14.407)	(0,02)
						EUR (103.938)	(0,12)

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
10-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(97)	USD	(11.750.641)	20.06.2018	(87.149)	(0,07)
5-Year US Treasury Note Future	Kauf	98	USD	11.217.172	29.06.2018	33.688	0,03
						USD (53.461)	(0,04)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

11 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

(Fortsetzung)

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond den folgenden ausstehenden Terminkontrakt:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter (Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
10-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(218)	USD	(26.408.656)	20.06.2018	(217.688)	(0,07)
						USD (217.688)	(0,07)

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
10-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(1)	USD	(129.859)	20.06.2018	(1.863)	(0,03)
20-Year US Long Bond	Verkauf	(1)	USD	(146.625)	20.06.2018	(3.570)	(0,06)
US Ultra Bond	Verkauf	(1)	USD	(160.469)	20.06.2018	(5.320)	(0,08)
5-Year US Treasury Note Future	Kauf	4	USD	457.844	29.06.2018	1.469	0,02
						USD (9.284)	(0,15)

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond den folgenden ausstehenden Terminkontrakt:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter (Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
10-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(16)	USD	(1.938.250)	20.06.2018	(12.000)	(0,02)
						USD (12.000)	(0,02)

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Nifty Bank Index Future	Kauf	87	USD	1.763.838	26.04.2018	4.112	0,01
Topix Index Future	Kauf	49	JPY	7.862.572	07.06.2018	(76.853)	(0,11)
E-mini S&P 500 Future (CME)	Verkauf	(149)	USD	(19.690.350)	15.06.2018	1.088.072	1,55
Call DJ Euro Stoxx 50	Kauf	68	EUR	2.743.894	15.06.2018	(56.032)	(0,08)
						USD 959.299	1,37

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

11 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

(Fortsetzung)

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
E-mini S&P 500 Future (CME)	Verkauf	(218)	USD	(28.808.699)	15.06.2018	1.316.963	0,59
E-mini S&P 500 Future (CME)	Verkauf	(84)	USD	(11.120.549)	21.09.2018	(61.950)	(0,03)
						USD 1.255.013	0,56

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities* die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-Bobl Future	Verkauf	(3)	EUR	(393.749)	07.06.2018	(230)	(0,01)
Euro-Schatz Future	Verkauf	(2)	EUR	(223.950)	07.06.2018	(10)	0,00
10-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(2)	USD	(197.001)	20.06.2018	(89)	0,00
Long Gilt Future	Verkauf	(2)	GBP	(280.184)	27.06.2018	(377)	(0,01)
5-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(2)	USD	(186.138)	29.06.2018	(152)	0,00
						EUR (858)	(0,02)

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-OAT Future	Verkauf	(7)	EUR	(1.330.858)	07.06.2018	(23.158)	(0,21)
Euro-Bobl Future	Verkauf	(15)	EUR	(2.421.268)	07.06.2018	(19.370)	(0,18)
Euro-Buxl Future	Kauf	3	EUR	610.178	07.06.2018	18.153	0,16
Euro-Bund Future	Kauf	1	EUR	196.075	07.06.2018	2.964	0,03
10-Year US Treasury Note Future	Kauf	8	USD	969.125	20.06.2018	7.063	0,06
US Ultra Bond	Kauf	6	USD	962.813	20.06.2018	31.546	0,30
						USD 17.198	0,16

*Siehe Erläuterung 1.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

12 OPTIONEN ZUM MARKTWERT

Zum 31. März 2018 hatte Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income die folgenden ausstehenden Optionen:

Beschreibung	Kontrahent	Basis	Währung	Kontrakte	Fälligkeits- datum	Commitment in der Portfolio- Basiswährung	Marktwert in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
Optionen auf Futures								
Call S&P 500 Index	UBS AG	2.800,000	USD	(158)	20.04.2018	44.240.000*	(52.930)	(0,02)
Call DJ Euro Stoxx 50	UBS AG	3.475,000	EUR	(498)	20.04.2018	21.283.169*	(34.911)	(0,01)
Call FTSE 100 Index	UBS AG	7.275,000	GBP	(156)	20.04.2018	15.920.377*	(35.013)	(0,01)
							USD (122.854)	(0,04)

*Das Engagement in Short-Call-Positionen ist unbegrenzt.

13 POOLING

Die SICAV kann die Gesamtheit oder einen Teil des Vermögens zweier oder mehrerer Portfolios („beteiligte Portfolios“) in Form eines Pools anlegen und verwalten. Ein solcher Vermögenspool wird durch Übertragung von Barmitteln oder anderen Vermögenswerten der jeweiligen Teilnehmenden Portfolios gebildet (wobei diese Vermögenswerte im Hinblick auf die Anlagepolitik des betreffenden Pools geeignet sein müssen).

Der Anteil eines Teilnehmenden Portfolios an einem Vermögenspool wird anhand von rechnerischen Anteilen (Units) gleichen Werts an dem Vermögenspool bestimmt.

Zum 31. März 2018 verfügte die SICAV über kein Pooling von Vermögenswerten, jedoch ist das Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation Portfolio zu Anlageverwaltungszwecken nach Anlageklassen in mehrere Körbe aufgeteilt, die ausschließlich von ihm selbst gehalten werden.

14 ÄNDERUNGEN BEI DER ZUSAMMENSETZUNG DER AUFSTELLUNGEN DER WERTPAPIERANLAGEN

Änderungen bei den Aufstellungen der Wertpapieranlagen werden den Anteilinhabern auf Anfrage am Sitz der SICAV kostenlos zur Verfügung gestellt.

15 VERWÄSSERUNGSANPASSUNG

In einem Portfolio kann es zu einer Verwässerung des Nettoinventarwerts je Anteil kommen, wenn Anleger Anteile an einem Portfolio zu einem Preis kaufen oder verkaufen, der die Handels- und weitere Kosten nicht widerspiegelt, welche entstehen, wenn Wertpapiergeschäfte vom Anlageverwalter getätigt werden, um Barmittelzuflüsse oder -abflüsse auszugleichen. Um diesem Effekt entgegenzuwirken, kann eine Verwässerungsanpassung (gemäß der Definition dieses Begriffs im Verkaufsprospekt) vorgenommen werden, um die Interessen der Anteilinhaber der SICAV zu schützen. Wenn an einem Bewertungstag sämtliche Nettotransaktionen in Anteilen eines Portfolios eine zuvor festgelegte Schwelle übersteigen, die von der Verwaltungsgesellschaft regelmäßig für jedes Portfolio festgelegt und geprüft wird, kann der Nettoinventarwert je Anteil nach oben oder unten angepasst werden, um Nettozuflüsse bzw. Nettoabflüsse widerzuspiegeln.

Eine Verwässerungsanpassung kann auf sämtliche Portfolios mit Ausnahme des Portfolios von Threadneedle (Lux) - Mondrian Investment Partners - Emerging Markets Equity und Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities angewendet werden. Das Ausmaß der Preisanpassung wird von der Verwaltungsgesellschaft festgelegt, um Handels- und sonstige Kosten zu berücksichtigen. Die Anpassung kann je nach Portfolio variieren und ist auf maximal 2 % des ursprünglichen Nettoinventarwertes je Anteil beschränkt, mit Ausnahme des Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity, bei dem die Anpassung nicht mehr als 5 % des ursprünglichen Nettoinventarwertes je Anteil betragen wird. Der offizielle Nettoinventarwert je Anteil zum Ende des Berichtszeitraums, der im Abschnitt „Statistische Informationen“ des vorliegenden Berichts veröffentlicht ist, kann daher eine Verwässerungsanpassung enthalten, die ggf. in der Aufstellung des Nettovermögens und in der Aufwands- und Ertragsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens nicht berücksichtigt wird.

Zum Ende des Geschäftsjahres war eine Verwässerungsanpassung wie nachstehend beschrieben auf die folgenden Portfolios angewendet worden:

Portfolio	NIW vor Verwässerung	Verwässerungs- anpassung	NIW nach Verwässerung
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	83.714.363	(159.057)	83.555.306
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	52.527.052	157.581	52.684.633
Threadneedle (Lux) - Greater China Equities	3.831.195	(8.812)	3.822.383
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	78.477.578	(86.325)	78.391.253

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

16 TRANSAKTIONSKOSTEN

Für das Berichtsjahr entstanden der SICAV wie folgt Transaktionskosten bezüglich des Kaufs oder Verkaufs von übertragbaren Wertpapieren oder Geldmarktinstrumenten:

Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - European Social Bond ^{1,2}	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond ¹	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation ¹	USD	32.884
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income ¹	USD	246.949
Threadneedle (Lux) - Global Focus	USD	848.891
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	USD	15.530
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	EUR	20.643
Threadneedle (Lux) - American	USD	205.612
Threadneedle (Lux) - American Select	USD	8.846
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	USD	940.792
Threadneedle (Lux) - Asian Focus	USD	54.475
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	USD	106.552
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	USD	512.207
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities ²	USD	3.777
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	EUR	133.267
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	EUR	595.161
Threadneedle (Lux) - European Select	EUR	72.091
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	USD	178.523
Threadneedle (Lux) - Greater China Equities	USD	9.740
Threadneedle (Lux) - Global Energy Equities ²	USD	26.881
Threadneedle (Lux) - Global Technology	USD	164.038
Threadneedle (Lux) - Mondrian Investment Partners - Emerging Markets Equity	USD	369.972
Threadneedle (Lux) - UK Equities	GBP	349.841
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	GBP	173.157
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	USD	47.074
Threadneedle (Lux) - STANLIB Global Emerging Markets Property Securities	USD	17.218
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	USD	92.793
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities ²	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	EUR	88.627
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities ¹	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity ²	USD	18.014

Die Transaktionskosten sind in den Gesamtkosten der Anlage gemäß den Aufstellungen der Wertpapieranlagen enthalten. Der Betrag der während des Berichtsjahres von der SICAV getragenen Transaktionskosten ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens unter der Überschrift „Realisierter Nettogewinn / (-verlust) aus Wertpapierverkäufen“ und „Nettoveränderung des nicht realisierten Nettogewinns / (-verlusts) aus Wertpapieren“ enthalten.

¹Bei festverzinslichen Wertpapieren sind die Transaktionskosten nicht vom Kaufpreis des Wertpapiers getrennt ermittelbar und können daher nicht getrennt ausgewiesen werden.

²Siehe Erläuterung 1.

17 INFORMATIONEN ZU BARSICHERHEITEN (CASH COLLATERAL)

In der nachstehenden Tabelle sind die aktivischen und passivischen Barsicherheitsalden gegenüber Maklern zum 31. März 2018 dargestellt:

Portfolios	Kontrahent	Anlagentyp	Währung	Barsicherheiten
Fällig an Makler				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	USD	260.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	RBS	Termingeschäfte	EUR	230.000
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	2.650.000
Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	140.000
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	760.000

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

17 INFORMATIONEN ZU BARSICHERHEITEN (CASH COLLATERAL)

(Fortsetzung)

Portfolios	Kontrahent	Anlagentyp	Währung	Barsicherheiten
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	Barclays Bank	Swaps	USD	180.000
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	RBS	Termingeschäfte	USD	160.000
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	160.000
Threadneedle (Lux) - American	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	30.000
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	260.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	10.000
Threadneedle (Lux) - European Select	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	350.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Merrill Lynch	Swaps	USD	2.600.000
-Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	440.000
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	USD	190.000
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	Goldman Sachs	Termingeschäfte und Swaps	USD	170.000
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	Deutsche Bank	Termingeschäfte und Swaps	USD	90.000
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	Citi Global Mkts	Swaps	USD	140.000
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	JPM Securities	Termingeschäfte	USD	10.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Goldman Sachs	Swaps	EUR	1.220.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	590.000
Fällig von Maklern				
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	Citi Global Mkts	Termingeschäfte und Swaps	USD	10.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Citi Global Mkts	Swaps	USD	700.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Securities	Swaps	USD	60.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Barclays Bank	Termingeschäfte und Swaps	USD	260.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Goldman Sachs	Termingeschäfte und Swaps	USD	1.310.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	HSBC Bank	Termingeschäfte	EUR	120.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Citi Global Mkts	Swaps	EUR	130.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Barclays Bank	Termingeschäfte und Swaps	EUR	510.000
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	200.000
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	HSBC Bank	Termingeschäfte	USD	110.000
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	400.000
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	JPM Securities	Termingeschäfte	USD	300.000
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	Citi Global Mkts	Termingeschäfte und Swaps	USD	10.000
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	150.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Goldman Sachs	Termingeschäfte	USD	230.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	UBS	Optionen	USD	330.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPM Securities	Termingeschäfte	USD	350.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	RBS	Termingeschäfte	USD	550.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	1.280.000
Threadneedle (Lux) - Global Focus	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	160.025
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	60.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	10.000
Threadneedle (Lux) - Global Technology	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	130.000
Threadneedle (Lux) - UK Equities	JPM Chase	Termingeschäfte	GBP	10.000
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	Citi Global Mkts	Swaps	USD	110.000
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	Barclays Bank	Swaps	USD	60.000
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	JPM Securities	Termingeschäfte und Swaps	USD	100.000
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	MStanley&Co	Swaps	USD	110.000
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	Goldman Sachs	Termingeschäfte und Swaps	USD	70.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Macquarie	Swaps	USD	2.090.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Goldman Sachs	Swaps	USD	2.420.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	USD	3.640.000

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

18 GEGENSEITIGE ANLAGEN IN PORTFOLIOS

Zum 31. März 2018 investieren das Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond Portfolio, das Threadneedle (Lux) – Global Multi Asset Income Portfolio und das Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond Portfolio in Anteile des Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond Portfolio, das Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation Portfolio investiert in Anteile des Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio und das Threadneedle (Lux) – Global Multi Asset Income Portfolio investiert in Anteile des Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds.

Der Wert der vom Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond Portfolio gehaltenen Anteile beläuft sich auf USD 3.611 und stellt 0,00 % des Nettovermögens des Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond Portfolio dar.

Der Wert der vom Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation Portfolio gehaltenen Anteile beläuft sich auf USD 5.947.862 und stellt 1,08 % des Nettovermögens des Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio dar.

Der Wert der vom Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income Portfolio gehaltenen Anteile beläuft sich auf USD 7.288.931 und stellt 5,53 % des Nettovermögens des Global Emerging Market Short-Term Bonds dar. Der Wert der vom Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income Portfolio gehaltenen Anteile beläuft sich auf USD 15.345.953 und stellt 5,18 % des Nettovermögens des Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond Portfolio dar.

Der Wert der vom Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond Portfolio gehaltenen Anteile beläuft sich auf USD 1.852 und stellt 0,00 % des Nettovermögens des Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond Portfolio dar.

Die Auswirkungen der Transaktionen im Rahmen von gegenseitigen Anlagen wurden aus der kombinierten Aufstellung des Nettovermögens und der Aufstellung der Veränderung des Nettovermögens entfernt.

Bitte lesen Sie auch Erläuterung 2 xi) zu Rückerstattungen der Vermögensverwaltungsgebühr.

19 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

Die Gesamtkostenquote wird gemäß der Richtlinie der Swiss Funds & Asset Management Association (SFAMA) ermittelt.

Die verwendete Formel lautet wie folgt:

Die TER erfasst sämtliche den Anteilsklassen laufend belasteten Kommissionen und Kosten (Betriebskosten) rückblickend als prozentualen Anteil des Nettovermögens der Anteilsklassen und wird anhand der folgenden Formel berechnet.

$$\text{TER \%} = \frac{\text{Gesamtbetriebskosten}}{\text{Durchschnittliches Nettovermögen}} \times 100$$

Wenn ein Fonds mehr als 10 % in andere Organismen für gemeinsame Anlagen (Zielfonds) investiert, umfasst die Berechnung den Anteil des Fonds an den Aufwendungen der Zielfonds abzüglich erhaltener Gebührennachlässe.

Die Gesamtkostenquote für das Geschäftsjahr bis zum 31. März 2018 beträgt:

Portfolio	Klasse	Gesamtkostenquote (TER)
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	AEH	1,20 %
	AU	1,20 %
	DEC	1,65 %
	DEH	1,65 %
	DU	1,65 %
	W	1,05 %
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	AEC	0,85 %
	AEH	0,85 %
	AKH	0,85 %
	AU	0,85 %
	AUP	0,85 %
	DEC	1,60 %
	DEH	1,60 %
	DU	1,60 %
	DUP	1,68 % ^{2,3}
	IEH	0,65 %
IGH	0,65 %	
IKH	0,65 %	

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

19 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	Gesamtkostenquote (TER)
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond		
(Fortsetzung)	IU	0,65 %
	NEH	0,45 %
	NGC	0,45 %
	NGH	0,45 %
	NU	0,45 %
	ZEH	0,60 %
	ZGH	0,60 %
	ZU	0,60 %
Threadneedle (Lux) - European Social Bond¹	IE	0,50 %
	IEP	0,50 %
	IFH	0,50 %
	LE	0,40 %
	ZE	0,55 %
	ZFH	0,55 %
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	AE	1,15 %
	AEP	1,15 %
	DE	1,70 %
	DEP	1,70 %
	IE	0,55 %
	W	1,15 %
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	AEC	1,65 %
	AEH	1,65 %
	ASH	1,65 %
	AU	1,65 %
	AUP	1,65 %
	BU	2,78 % ³
	BUP	2,78 % ³
	DEC	2,20 % ⁴
	DEH	2,21 % ⁴
	DU	2,21 % ⁴
	IEH	0,97 % ⁴
	W	1,30 %
	WEH	1,30 %
	XUP	0,06 % ²
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	AEC	1,65 %
	AEH	1,65 %
	ASH	1,65 %
	AU	1,65 %
	AUP	1,65 %
	DEH	2,21 % ⁴
	DU	2,22 % ⁴
	IEH	1,01 % ⁴
	SU	1,80 %
	SUP	1,80 %
	W	1,30 %
	XUP	0,06 % ²
	ZU	0,90 %
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	AEC	1,60 %
	AEH	1,60 %
	ASC	1,60 %
	ASH	1,60 %
	AU	1,60 %
	AUP	1,60 %
	BU	2,77 % ³

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

19 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	Gesamtkostenquote (TER)
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds (Fortsetzung)	BUP	2,77 % ³
	DEH	1,83 % ⁴
	DU	1,84 % ⁴
	IEH	0,97 % ⁴
	W	1,45 %
	ZEH	0,90 %
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	AEC	1,55 %
	AEH	1,55 %
	ASH	1,55 %
	AU	1,55 %
	AUP	1,55 %
	BU	2,55 %
	BUP	2,55 %
	DEC	2,44 % ⁴
	DEH	2,42 % ⁴
	DU	2,43 % ⁴
	IEC	0,65 %
	IEH	0,65 %
	TEH	0,65 %
	XUP	0,15 %
	ZGH	0,84 % ²
	ZU	0,90 %
Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	AEH	1,10 %
	AU	1,10 %
	DEH	1,45 %
	DU	1,45 %
	IEC	0,50 %
	IEH	0,50 %
	IFH	0,50 %
	IU	0,50 %
	IUP	0,50 %
	XUP	0,05 % ²
	ZEH	0,70 %
	ZFH	0,70 %
	ZU	0,70 %
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	AEH	1,55 %
	AS	1,55 %
	ASC	1,55 %
	ASH	1,55 %
	AU	1,55 %
	AUP	1,55 %
	AVC	1,68 % ²
	AVH	1,68 % ²
	DEH	1,98 % ⁴
	IEH	0,97 % ⁴
	IGH	0,97 % ⁴
	ISH	0,97 % ⁴
	IU	1,03 % ⁴
	XU	0,15 %
	ZU	0,90 %
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	AEC	1,65 %
	AEH	1,65 %
	AU	1,65 %

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

19 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	Gesamtkostenquote (TER)
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation		
(Fortsetzung)	AUP	1,65 %
	BU	2,78 % ³
	DEH	2,54 % ⁴
	DU	2,56 % ⁴
	IGH	0,95 %
	IU	0,95 %
	W	1,75 %
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	AE	1,55 %
	AEC	1,55 %
	AEH	1,55 %
	AEP	1,55 %
	AU	1,55 %
	AUP	1,55 %
	DEC	2,30 %
	DEH	2,25 % ³
	DEP	2,30 %
	DU	2,30 %
	DUP	2,30 %
	ZE	1,00 % ²
	ZEH	1,05 %
	ZU	1,05 %
Threadneedle (Lux) - Global Focus	AEH	1,80 %
	AEP	1,80 %
	AU	1,80 %
	BU	2,85 %
	DEH	2,55 %
	DU	2,55 %
	IE	1,08 % ⁴
	IU	1,02 % ⁴
	W	1,75 %
	XU	0,15 %
	ZE	1,05 %
	ZEP	1,05 %
	ZG	1,05 %
	ZU	1,05 %
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	AEH	1,80 %
	AU	1,80 %
	DEH	2,79 % ⁴
	DU	2,79 % ⁴
	IEH	1,03 % ⁴
	ZU	1,05 %
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	AE	1,80 %
	AGH	1,80 %
	DE	2,30 %
	IE	0,95 %
	IGH	0,95 %
	XGH	0,15 %
	ZGH	1,05 %
Threadneedle (Lux) - American	AEH	1,80 %
	AU	1,80 %
	BU	2,85 %
	DEH	2,31 % ⁴
	DU	2,32 % ⁴

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

19 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	Gesamtkostenquote (TER)
Threadneedle (Lux) - American		
(Fortsetzung)	IEH	0,90 %
	IU	0,90 %
	W	1,50 %
Threadneedle (Lux) - American Select	AEH	1,80 %
	AU	1,80 %
	DEH	2,55 %
	DU	2,55 %
	IEH	1,00 %
	W	1,75 %
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	AE	1,80 %
	AF	1,80 %
	AS	1,87 % ²
	ASH	1,80 %
	AU	1,71 % ⁴
	DE	2,76 % ⁴
	IE	1,05 % ⁴
	IF	1,07 % ⁴
	ISH	1,07 % ⁴
	IU	1,16 % ⁴
	XUP	0,15 %
	ZE	1,05 %
	ZEH	1,05 %
	ZF	1,05 %
	ZU	1,05 %
Threadneedle (Lux) - Asian Focus	AE	1,80 %
	AF	1,80 %
	AS	1,87 % ²
	ASH	1,80 %
	AU	1,86 % ⁴
	DE	2,77 % ⁴
	DEH	2,78 % ⁴
	IE	1,07 % ⁴
	IF	1,07 % ⁴
	ISH	1,07 % ⁴
	IU	1,07 % ⁴
	XUP	0,15 %
	ZE	1,05 %
	ZEH	1,05 %
	ZF	1,05 %
	ZU	1,05 %
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	AE	1,80 %
	AEP	1,80 %
	AF	1,80 %
	AFP	1,80 %
	ASC	1,80 %
	ASH	1,80 %
	ASP	1,88 % ⁴
	AU	1,80 %
	AUP	1,80 %
	AVC	1,80 %
	AVH	1,80 %
	DE	2,76 % ⁴

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

19 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	Gesamtkostenquote (TER)
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income (Fortsetzung)	IE	1,06 % ⁴
	IEP	1,06 % ⁴
	IF	1,09 % ⁴
	IFP	1,09 % ⁴
	ISH	1,07 % ⁴
	IU	1,11 % ⁴
	IUP	1,09 % ⁴
	ZE	1,05 %
	ZEH	1,05 %
	ZEP	1,05 %
	ZF	1,05 %
	ZFP	1,05 %
	ZU	1,05 %
	ZUP	1,05 %
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	AEC	1,85 %
	AEH	1,85 %
	AU	1,85 %
	AUP	1,85 %
	DU	2,35 %
	IU	1,05 %
	XS	0,15 %
	XSH	0,15 %
	ZEH	1,10 %
	ZFH	1,10 %
	ZGH	1,10 %
	ZU	1,10 %
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities¹	AE	0,70 %
	AEH	0,70 %
	AU	0,70 %
	AUP	0,70 %
	DE	0,90 %
	DEH	0,90 %
	DU	0,90 %
	IE	0,35 %
	IEC	0,35 %
	IEH	0,35 %
	IFH	0,35 %
	IU	0,35 %
	ZEH	0,45 %
	ZFH	0,45 %
	ZU	0,45 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	AE	1,80 %
	ASH	1,80 %
	AUH	1,80 %
	BUH	2,77 % ³
	DE	2,54 % ⁴
	IE	1,00 % ⁴
	W	1,75 %
	XE	0,15 %
	ZUH	1,05 %

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

19 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	Gesamtkostenquote (TER)
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	AE	1,85 %
	ASH	1,85 %
	DE	2,75 %
	IE	1,10 %
	W	1,90 %
Threadneedle (Lux) - European Select	AE	1,80 %
	AGH	1,41 % ⁴
	AUH	1,41 % ⁴
	IE	0,95 %
	ZG	1,05 %
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	ZGH	1,05 %
	AEH	1,80 %
	AU	1,80 %
	AUP	1,80 %
	DEH	2,77 % ⁴
Threadneedle (Lux) - Greater China Equities	DU	2,79 % ⁴
	DUP	2,84 % ⁴
	IEP	1,07 % ⁴
	W	2,00 %
	ZGH	1,05 %
	ZUP	1,05 %
	AEH	1,85 %
	AU	1,85 %
	DEH	2,85 %
	DU	2,85 %
W	2,00 %	
Threadneedle (Lux) - Global Technology	AEH	1,95 %
	AS	1,85 % ⁴
	AU	1,95 %
	BU	2,35 %
	DU	2,30 %
	IEH	1,11 % ⁴
Threadneedle (Lux) - Mondrian Investment Partners - Emerging Markets Equity	ZFH	1,15 %
	ZU	1,15 %
Threadneedle (Lux) - UK Equities	M	1,19 % ⁷
	AEH	1,95 % ⁴
	AFH	1,80 %
	AG	1,80 %
	AGP	1,80 %
	DEH	2,60 %
	DG	2,60 %
	IEH	0,85 %
	IG	0,85 %
	IGP	0,85 %
	ZEH	1,05 %
	ZFH	1,05 %
	ZG	1,05 %
	ZGP	1,05 %
	ZUH	1,11 % ⁴
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	AE	1,80 %
	AEC	1,80 %
	AEH	1,80 %
	AG	1,80 %
	ASC	1,80 %

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

19 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	Gesamtkostenquote (TER)
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income (Fortsetzung)	AUC	1,80 %
	DE	2,43 % ⁴
	DEC	2,55 %
	DEH	2,60 % ⁴
	DG	2,55 %
	DGP	2,55 %
	IE	0,85 %
	IEH	0,85 %
	IG	0,85 %
	IGP	0,85 %
	IU	0,85 %
	IUH	0,64 % ²
	LG	0,70 %
	LGP	0,70 %
	ZE	1,05 %
	ZEH	1,05 %
	ZFH	1,00 % ⁴
	ZG	1,05 %
	ZGP	1,05 %
	ZUH	1,05 %
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	IU	1,60 %
	ZU	1,60 %
Threadneedle (Lux) - STANLIB Global Emerging Markets Property Securities	IU	1,60 %
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	AEH	1,80 %
	AFH	1,80 %
	AGH	1,80 %
	AU	1,80 %
	DEH	2,35 % ⁴
	DU	2,30 %
	IEH	0,95 %
	IGH	0,95 %
	IU	0,95 %/1,09 % ⁶
	XGH	0,15 %
	ZGH	1,05 %
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	AEC	1,58 % ²
	AEH	1,50 %
	DEH	2,37 % ²
	IEH	0,80 %
	IGH	0,80 %
	ISH	0,80 %
	IU	0,80 %
	IVH	0,80 %
	LEH	0,50 %
	LGH	0,50 %
	LU	0,43 % ³
	ZEH	1,00 %
	ZFH	1,00 %
	ZU	1,05 % ²
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities¹	AE	1,20 %
	AFH	1,14 % ³
	AUH	1,13 % ³
	DE	1,75 %

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

19 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	Gesamtkostenquote (TER)
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities¹ (Fortsetzung)	IE	0,55 %
	IEP	0,55 %
	IGH	0,68 % ³
	IUH	0,68 % ³
	JE	0,45 %
	JGH	0,45 %
	JUH	0,45 %
	LE	0,40 %
	LEP	0,40 %
	LGH	0,45 % ³
	YE	0,60 %
	YGH	0,68 % ³
	YUH	0,68 % ³
	ZE	0,70 %
	ZFH	0,70 %
	ZGH	0,70 %
	ZUH	0,70 %
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	AEH	1,30 %
	AGH	1,30 %
	AU	1,30 %
	DEH	2,20 %
	DU	2,20 %
	IEH	0,75 %
	IU	0,75 %
	ZGH	0,80 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	AE	1,85 %
	AEP	1,93 % ⁵
	AUH	1,93 % ²
	DE	2,45 % ²
	IE	0,95 %
	IGH	0,95 %
	LE	0,58 %
	XGH	0,15 %
	ZE	1,05 %
	ZF	1,14 % ² /2,19 % ⁶
	ZGH	1,05 %
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	AEH	2,05 %
	AFH	2,05 %
	AGH	2,10 % ⁴
	ASH	2,05 %
	AU	2,05 %
	DEH	2,55 %
	DU	2,60 % ⁴
	IEH	1,21 % ⁴
	IFH	1,21 % ⁴
	IGH	1,20 % ⁴
	IKH	1,19 % ⁴
	IU	1,21 % ⁴
	XU	0,15 %
	ZEH	1,05 %
	ZFH	1,11 % ⁴
	ZGH	1,05 %
	ZU	1,05 %

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

19 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	Gesamtkostenquote (TER)
Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity ¹	AU	1,85 %
	XU	0,25 %

¹Siehe Erläuterung 1.

²Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.

³Aufgrund der Verwendung der Durchschnittsberechnungsmethode weicht die aktuelle Gesamtkostenquote der während des Berichtszeitraums aufgelegten Anteilklassen leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilklassen übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.

⁴Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der ab dem 1. Februar 2018 geltenden Gebührensenkung von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab (siehe Erläuterung 5). Da die Gebührensenkung nur für 2 Monate galt, bleibt die TER einiger Klassen zum Jahresende höher als erwartet.

⁵Aufgrund der Verwendung der Durchschnittsberechnungsmethode und einer umfangreichen Rücknahme in dieser Anteilklasse weicht die aktuelle Gesamtkostenquote leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.

⁶Einschließlich Erfolgsgebühr.

⁷Depot- und Unterdepotgebühren werden dieser Anteilklasse zusätzlich berechnet.

20 SONSTIGE VERMÖGENSWERTE

Da einige Märkte zum Jahresende geschlossen waren, wurde eine Anpassung des beizulegenden Zeitwerts vorgenommen, um ein Markt-Timing auf der Grundlage des geltenden Preisfindungsverfahrens auf Fondsebene zu vermeiden.

21 TERMINEINLAGEN

Die folgende Tabelle zeigt die von der SICAV zum 31. März 2018 gehaltenen Termineinlagen:

Portfolios	Kontrahent	Währung	Betrag der Termineinlage
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	Lloyds TSB Financial Market	USD	3.001.968
	BNP Paribas Paris	USD	2.506.446
	Summe	USD	5.508.414
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	Lloyds TSB Financial Market	USD	3.009.808
	Standard Chartered Bank	USD	3.008.115
	Rabobank Nederland Utrecht	USD	3.003.787
	Summe	USD	9.021.710
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	The Bank of Tokyo Mitsubishi	EUR	5.699.575
	Summe	EUR	5.699.575
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Sumitomo Bank Ltd London	USD	17.264.829
	Bank of Nova Scotia	USD	17.167.315
	Lloyds TSB Financial Market	USD	16.226.978
	ANZ Banking Group Ltd	USD	16.210.383
	BNP Paribas Paris	USD	15.188.843
	The Bank of Tokyo Mitsubishi	USD	15.181.218
	RBS London	USD	10.216.665
	Summe	USD	107.456.231
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	BNP Paribas Paris	USD	400.288
	Summe	USD	400.288
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	The Bank of Tokyo Mitsubishi	EUR	1.998.584
	Commerzbank London	EUR	1.997.661
	National Bank of Abu Dhabi	EUR	1.898.786
	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	1.898.696
	BNP Paribas Paris	EUR	1.793.278
	Lloyds TSB Financial Market	EUR	1.791.479
	Summe	EUR	11.378.484

22 EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG

Der Threadneedle (Lux) - Greater China Equities Portfolio wurde am 16. April 2018 geschlossen.

Das Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return Portfolio wurde am 25. April 2018 aufgelegt.

Der Threadneedle (Lux) - Mondrian Investment Partners - Emerging Markets Equity Portfolio wird am 28. Juni 2018 geschlossen.

Gesamtrisiko (ungeprüft)

Gesamtrisiko und Hebeleffekte

Das Gesamtrisiko des OGAW wird unter einem Commitment-Ansatz, einem absoluten Value-at-Risk-Ansatz (absoluter VaR) oder einem relativen Value-at-Risk-Ansatz (relativer VaR) verwaltet.

Die Informationen zum Gesamtmarktrisiko für das Geschäftsjahr zum 31. März 2018 lauten wie folgt:

Commitment-Ansatz

Alle Portfolios, die nicht unter den VaR-Ansatz fallen, wenden zur Kontrolle und Bemessung des Gesamtrisikos den Commitment-Ansatz an.

Das Gesamtrisiko der Teilfonds wird auf Grundlage des Commitment-Ansatzes in Übereinstimmung mit der in den ESMA-Richtlinien 10-788 beschriebenen Methodik berechnet.

Für den Zeitraum von April 2017 bis März 2018:

Teilfonds, die einen VaR-Ansatz nutzen	Berechnungsmethode*	VaR-Modell*	Referenzportfolio	VaR-Grenze (%)	Einjährig rollierend				
					Niedrigste Nutzung der VaR-Grenze	Höchste Nutzung der VaR-Grenze	Durchschnittliche Nutzung der VaR-Grenze	Durchschnittliches Commitment-Engagement	Durchschnittliche Summe der Nennwerte
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	Relativer VaR	Kovarianz	Barclays Capital Global Aggregate Bond Index	1,8 x Vergleichsindex-VaR	54 %	82 %	68 %	252,33 %	785,71 %
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Relativer VaR	Kovarianz	Barclays Capital Global Aggregate Corporates Index abgesichert in USD	1,5 x Vergleichsindex-VaR	65 %	106 %	72 %	9,87 %	67,63 %
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Relativer VaR	Kovarianz	Merrill Lynch EMU Large Cap Investment Grade 3-5 Year Index	2 x Vergleichsindex-VaR	47 %	88 %	70 %	46,07 %	90,03 %
Threadneedle (Lux) Flexible Asian Bond	Relativer VaR	Kovarianz	50 % Citi Asian Government bond Index Investible (LocalCCY), 50% JPMorgan Asian Credit Index Sovereign-only sub index (Hard CCY)	1,8 x Vergleichsindex-VaR	40 %	63 %	54 %	15,54 %	36,54 %
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Absoluter VaR	Kovarianz	entfällt	9,4	21 %	57 %	48 %	5,17 %	55,15 %
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Absoluter VaR	Kovarianz	entfällt	8	18 %	31 %	21 %	17,64 %	45,20 %
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	Absoluter VaR	Historisch	entfällt	11	27 %	86 %	51 %	1673,26 %	2094,25 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha*	Absoluter VaR	Kovarianz	entfällt	10	34 %	53 %	42 %	0,00 %	0,25 %
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities**	Absoluter VaR	Kovarianz	entfällt	3,3	8 %	12 %	10 %	0,00 %	11,30 %
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	Absoluter VaR	Kovarianz	entfällt	6	23 %	42 %	29 %	278,46 %	896,29 %
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Relativer VaR	Historisch	Bloomberg Commodity Index	1,3 x Vergleichsindex-VaR	67 %	84 %	75 %	39,83 %	307,60 %

*Berechnungsmethode. Das VaR-Modell basiert auf einem Konfidenzintervall von 99% bei einer einmonatigen Haltedauer. Das Kovarianz-Modell nutzt die wöchentlichen Daten der vorherigen 3,5 Jahre und die historische Methode nutzt die täglichen Daten von zwei Jahren.

**Siehe Erläuterung 1. Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities war zum Ende des Jahres nicht vollständig investiert.

Informationen für Anteilinhaber (ungeprüft)

Die SICAV ist eine im Großherzogtum Luxemburg entsprechend der aktuellen Fassung des Gesetzes vom 10. August 1915 gegründete Investmentgesellschaft mit variablem Kapital („Société d'Investissement à Capital Variable“) und gilt gemäß Teil I der aktuellen Fassung des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“).

Die SICAV wurde am 10. Februar 1995 für unbegrenzte Dauer gegründet. Die Satzung der SICAV wurde erstmals am 31. März 1995 im Mémorial, Recueil des Sociétés et Associations des Großherzogtums Luxemburg („Mémorial“) veröffentlicht. Die daran vorgenommenen Änderungen vom 25. Juli 1997, 12. März 1999, 18. August 2004, 17. Oktober 2005, 25. Juli 2008, 31. Juli 2009, 31. August 2010, 29. Juli 2011, 13. August 2012, 28. März 2013 und 12. August 2013 wurden am 30. Oktober 1997, 22. April 1999, 15. September 2004, 3. November 2005, 10. September 2008, 21. Oktober 2010, 22. August 2011, 18. September 2012, 22. April 2013 und 16. September 2013 im Mémorial bekanntgegeben.

Die SICAV ist unter der Nummer R.C.S. Luxemburg B-50216 eingetragen.

Die Jahreshauptversammlung der Anteilinhaber der SICAV findet an ihrem eingetragenen Sitz oder einem sonstigen Ort in Luxemburg jährlich am letzten Freitag des Monats Juli um 14.00 Uhr oder, falls es sich dabei nicht um einen Bankgeschäftstag in Luxemburg handelt, am nächstfolgenden Bankgeschäftstag statt. Bekanntmachungen der Hauptversammlungen erfolgen in Einklang mit dem luxemburgischen Recht und den Gesetzen, die in den Ländern, in denen die Anteile öffentlich zum Kauf angeboten werden, allgemein gültig sind. Die Versammlungsmittelteil muss Ort und Termin der Versammlung, die Teilnahmevoraussetzungen, die Tagesordnung, die Mindestanwesenheitsanforderungen zur Beschlussfähigkeit und die Voraussetzungen für die Stimmabgabe enthalten.

Das Rechnungsjahr der SICAV endet am 31. März eines jeden Jahres.

Der geprüfte Jahresbericht und Jahresabschluss und der ungeprüfte Halbjahresbericht sind am eingetragenen Sitz der SICAV und am Hauptsitz der einzelnen Zahl- und Vertriebsstellen erhältlich. Die Gesamtabrechnung der SICAV wird in US-Dollar ausgedrückt.

Der Nettoinventarwert sowie die Ausgabe- und Rücknahmepreise der Anteile der SICAV werden am eingetragenen Sitz der SICAV veröffentlicht.

Dieser Bericht stellt kein Angebot und keine Aufforderung zum Kauf von Anteilen der SICAV dar. Zeichnungen werden nur auf Grundlage des Verkaufsprospekts, des letztverfügbaren Jahresberichts mit dem geprüften Jahresabschluss zum 31. März und, sofern danach veröffentlicht, des letztverfügbaren Halbjahresberichts zum 30. September akzeptiert.

Bestimmte Portfolios und/oder Anteilklassen in diesem Bericht sind zu diesem Datum möglicherweise nicht in allen Gebietskörperschaften zugelassen oder werden nicht in allen Gebietskörperschaften zum Kauf angeboten.

Dokument mit den wesentlichen Informationen für den Anleger („KIID“) - Bedingungen für die Zeichnung

Das Dokument mit den wesentlichen Anlegerinformationen (Key Investor Information Document, KIID) ist ein vorvertragliches Dokument und Anleger müssen bestätigen, dass sie das neueste KIID gelesen haben, bevor sie eine Zeichnung tätigen. Die Verwaltungsgesellschaft darf einen Zeichnungsantrag ablehnen, wenn ein Anleger bei Antragstellung nicht bestätigt, dass er das neueste KIID zur Kenntnis genommen hat. Das neueste KIID ist auf www.columbiathreadneedle.com erhältlich.

Offenlegung der Vergütung

Diese Angaben erfolgen in Bezug auf die Vergütungspolitik von Threadneedle Asset Management Sàrl („TAM Sàrl“ oder „die Gruppe“), die für den Manager („der Manager“) in Bezug auf die Richtlinie zu Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren („OGAW“) und sonstigen anwendbaren Regeln und Leitlinien gilt. Die Vergütungspolitik gilt für alle Tochtergesellschaften, die den Auflagen der OGAW-Richtlinie unterliegen, und wurde zuletzt im Juni 2017 vom Vergütungsausschuss genehmigt. Die Vergütungsauflagen gemäß der OGAW-Richtlinie wurden ab dem Performance-Jahr zum 1. Januar 2017 angewendet.

1. Der Vergütungsausschuss

Der Vergütungsausschuss von TAM Sàrl ist ein Unterausschuss des Verwaltungsrats von TAM Sàrl, der für die Entwicklung der Philosophie und der Ziele, die die Grundlage der Vergütungs- und Leistungsprogramme der Gruppe bilden, die Überprüfung und Genehmigung von Vergütungs- und Leistungsplänen, Richtlinien und Praktiken sowie für die Aufsicht und Genehmigung der Vergütung der Gruppe zuständig ist. Es wurde festgelegt, dass der Ausschuss unabhängig von den täglichen Geschäftsleitungsaufgaben der Gruppe sein muss. Seine Mitglieder sind Verwaltungsratsmitglieder der Gruppe, die von Ameriprise Financial, der Muttergesellschaft der Gruppe, ernannt werden.

Die derzeitigen Ausschussmitglieder sind Walter Berman und Ted Truscott. Sitzungen finden in der Regel im Januar, März, Juni, September und Dezember statt. Der Global Head, Reward handelt als Sekretär des Ausschusses. Der Ausschuss kann bei Bedarf einen Mitarbeiter oder funktionellen Spezialisten der Muttergesellschaft zu einer Sitzung einladen, um es sich zu ermöglichen, seine Aufgaben ordnungsgemäß zu erfüllen. Zu diesen gehört es sicherzustellen, dass die Vergütung im Einklang mit dem effektiven Risikomanagement steht und nicht das Eingehen übermäßiger Risiken fördert.

Informationen für Anteilinhaber (ungeprüft)

(Fortsetzung)

2. Festlegung von Pools zur erfolgsorientierten Vergütung

Der Manager traf seine Total Incentive Award-Entscheidungen aus separaten Pools, die das Immobiliengeschäft, die Vertriebseinheit, das Investmentgeschäft und die Support-Funktionen abdecken und zu Governance- und Aufsichtszwecken auf der regionalen EMEA-Ebene zusammengefasst wurden. Diese Pools werden im endgültigen Ermessen des Vergütungsausschusses unter Bezugnahme auf vier ungewichtete Faktoren festgelegt: einer „Top-Down“-Beurteilung der Marktgepflogenheiten, rechtlichen und aufsichtsrechtlichen Auflagen und anderer interner oder externer kontextueller Faktoren; einer „Bottom-Up“-Berechnung, die auf der Geschäftsleistung im Vergleich zur Plan- und Zielleistungsprämienebene des Unternehmens basiert (siehe „Leistungsbezogene Bezahlung“ weiter unten); die allgemeine finanzielle und strategische Leistung der Gruppe; und die finanzielle und strategische Leistung von Ameriprise Financial als Muttergesellschaft und Anteilinhaber der Gruppe. Der Ausschuss erhält während des gesamten Jahres zudem fortlaufend Berichte von der Risiko-Funktion bezüglich Risikobeurteilungen und allen Themen oder Bereichen, die mit dem Risikocontrolling oder risikobezogenen Verhaltensbedenken in Zusammenhang stehen.

Der Ausschuss berücksichtigt alle diese Faktoren, um eine ausgewogene Entscheidung für den Total Incentive-Pool für das betreffende Jahr zu treffen.

3. Festlegen individueller Total Incentive Awards

Individuelle Vergütungsentscheidungen sind vollständig diskretionär, wenn auch stark beeinflusst von der jährlichen Leistungsbeurteilung und von bekannten Vergütungsniveaus des Marktes für vergleichbare Tätigkeiten sowie von den im Pool verfügbaren Mitteln. Der Bereich Risiko und Compliance stellt einen wichtigen Faktor für die endgültige Leistungsbewertung dar und stellt sicher, dass sich Bedenken in Bezug auf das Risiko- und anderes relevantes Verhalten in den Leistungsbeurteilungen und folglich in den Vergütungsempfehlungen widerspiegeln. Die Führungskräfte des Bereichs Risiko und Compliance berichten zudem direkt an den Vergütungsausschuss für den Leistungsprämienprozess, um sicherzustellen, dass der Ausschuss einen direkten Bericht erhält, auf dessen Grundlage er seine Risikoanpassungsentscheidungen treffen kann.

Grundgehälter werden auf einem wettbewerbsfähigen Niveau gehalten, um sicherzustellen, dass es bei Bedarf möglich ist, keine Leistungsprämien zu gewähren.

Leistungsbezogene Bezahlung

Das Bottom-up-Element des Entscheidungsprozesses für den Leistungsprämienpool misst die Team- und breitere Geschäftsleistung anhand wichtiger Geschäftsziele für jeden Bereich der Gruppe, darunter die längerfristige Anlagenperformance der Geschäftsbereiche Investments und Immobilien und ein Mix aus Brutto- und Nettoumsätzen des Geschäftsbereichs Vertrieb. Die Anlagenperformance wird anhand der Benchmarks und des Risikoprofils jedes Fonds beurteilt. Alle Auswirkungen dieser Beurteilungen auf die Bottom-up-Berechnung werden gedeckelt, damit Manager nicht dazu angeregt werden, übermäßige Risiken einzugehen, um die Pools für Leistungsprämien aufzustocken. Zwar sind die finanziellen und strategischen Ergebnisse der Gruppe und der Muttergesellschaft wichtige Faktoren für die Festlegung der Pools, das Modell ist aber so aufgebaut, dass sichergestellt ist, dass die Kernziele des Unternehmens, darunter die Erzielung der Anlagenperformance für seine Kunden, ein ausdrücklicher und signifikanter Treiber für die Pool-Festlegung in diesen Geschäftsbereichen ist.

Einzelne diskretionäre Prämien aus dem verfügbaren Pool werden im Kontext wettbewerbsfähiger Leistungsprämienniveaus für die betreffende Tätigkeit stark von den Bewertungen der einzelnen Person gegenüber den Zielen und Werten der Gruppe bestimmt, die jeweils separat auf einer 5-Punkte-Skala bewertet werden, um sicherzustellen, dass der Werte-Beurteilung die gebührende Bedeutung zukommt. Die Ziele konzentrieren sich auf die wichtigsten Ergebnisse für die Rolle in diesem Jahr, insbesondere auf die Erzielung von Anlagenperformance für Mitarbeiter des Investment- und des Immobilienbereichs: Alle Mitarbeiter werden auch im Hinblick auf ein obligatorisches Risikomanagement-Ziel verwaltet. Die Anlagenperformance, sofern für die Rolle relevant, wird anhand der Benchmark und des Risikoprofils jedes Fonds bewertet.

Bewertungen werden über das gesamte Unternehmen hinweg auf ihre Übereinstimmung mit den Angaben der Leiter des Bereichs Risiko und Compliance hin geprüft, um Ausgewogenheit und die gebührende Beachtung des Risikomanagements sicherzustellen. Es gibt kein vordefiniertes Raster und keine durch Formeln ermittelten Leistungsprämien. Diese werden diskretionär festgelegt, um alle relevanten Faktoren berücksichtigen und widerspiegeln zu können.

Gewährung von Total Incentive Awards

Threadneedle glaubt, dass aufgeschobene Leistungsprämien für Höherverdienende eine Frage guter Praxis sind und einen wichtigen Teil bei der Ausrichtung der Interessen wichtiger Mitarbeiter an den langfristigen Interessen von Kunden und Anteilinhabern darstellen. In diesem Sinne können Total Incentive Awards für alle Mitarbeiter der Gruppe teilweise in Form von aufgeschobenen Prämien über das Ameriprise Financial Long-Term Incentive Award-Programm („LTIA“) gewährt werden, und für die Mitarbeiter des Geschäftsbereichs Investments durch ein Mittelaufschubprogramm. Aufgeschobene Zahlungen und die Gewährung von Prämien in Form von Instrumenten erfüllen die jeweils geltenden aufsichtsrechtlichen Auflagen.

Mitarbeiter, die die Anforderungen an identifizierte Mitarbeiter erfüllen, und jene, die eine vergleichbare Stellung innehaben, unterliegen einem größeren Aufschub. 50 % der gesamten Anreizprämien werden in Form von fondsgebundenen Anteilen gewährt, die nach ihrer Gewährung einer Haltedauer unterliegen. Die fondsgebundenen Anteile sollen die Performance eines Querschnitts von Produkten und Anlageklassen innerhalb der Region widerspiegeln.

Informationen für Anteilinhaber (ungeprüft)

(Fortsetzung)

4. Identifiziertes Personal

Identifizierte Mitarbeiter sind eingestuft als oberes Management, Personen mit wesentlichen Auswirkungen auf das Risikoprofil von OGAW, Personen innerhalb von Kontrollfunktionen und andere Mitarbeiter, deren Gesamtvergütung im selben Rahmen wie die von Angehörigen des oberen Managements und von Risikoträgern liegt, deren berufliche Aktivitäten wesentliche Auswirkungen auf die Risikoprofile des Managers oder die von ihm verwalteten Fonds haben. In der Praxis umfassen diese die genannten Verwalter der Fonds der Verwalter.

5. Offenlegung der Vergütungszahlung

Der Performance-Zeitraum für die Vergütung beruht auf dem Kalenderjahr.

Die von der Verwaltungsgesellschaft an sieben dem OGAW-V-Vergütungscode unterliegende Senior Manager im Hinblick auf ihre OGAW-Aktivitäten im Performance-Zeitraum 2017-18 gezahlte Gesamtvergütung belief sich auf 0,24 Mio. GBP, wovon 0,07 Mio. GBP auf feste und 0,17 Mio. GBP auf variable Vergütung entfielen. Die an andere dem OGAW-Vergütungscode unterliegende Mitarbeiter, deren Handlungen wesentliche Auswirkungen auf das Risikoprofil des Managers hatten, gezahlte Gesamtvergütung belief sich auf 2,05 Mio. GBP, wovon 1,05 Mio. GBP auf feste und 1,0 Mio. GBP auf variable Vergütung entfielen.

Informationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)

Der geprüfte Jahresbericht und Jahresabschluss, der ungeprüfte Halbjahresbericht, der Bericht über die Veränderungen des Portfoliobestands in dem Jahr, die Satzung, der Verkaufsprospekt (Schweizer Version) und die KIID können auf Anfrage kostenlos bei den Geschäftsstellen der Vertretung und Zahlstelle der SICAV in der Schweiz, RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, Zweigniederlassung Zürich, Bleicherweg 7, CH-8027 Zürich, Schweiz, oder am Sitz der SICAV angefordert werden.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit gibt keinen Aufschluss über die aktuelle oder zukünftige Wertentwicklung, und bei den Daten zur Wertentwicklung sind Provisionen und Kosten im Rahmen der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen nicht berücksichtigt.

Performance der Anteilklassen (ungeprüft)

Anteil- klasse	Name des Vergleichsindex	Kommentare	31. Dezember 2017		31. Dezember 2016		31. Dezember 2015	
			Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond								
AEH	Barclays Capital Global Aggregate		7,39 %	3,77 %	2,09 %	-2,99 %	-3,15 %	-8,49 %
AU	Barclays Capital Global Aggregate		7,39 %	6,16 %	2,09 %	-1,40 %	-3,15 %	-7,38 %
DEC	Barclays Capital Global Aggregate		7,39 %	3,26 %	2,09 %	-3,44 %	-3,15 %	-8,58 %
DEH	Barclays Capital Global Aggregate		7,39 %	3,35 %	2,09 %	-3,33 %	-3,15 %	-8,70 %
DU	Barclays Capital Global Aggregate		7,39 %	5,70 %	2,09 %	-1,80 %	-3,15 %	-7,70 %
W	Barclays Capital Global Aggregate		7,39 %	6,32 %	2,09 %	-1,21 %	-3,15 %	-7,16 %
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond								
AEC	Barclays Global Aggregate Corporates - in USD abgesichert		5,70 %	4,76 %	6,22 %	7,13 %	-0,24 %	-1,77 %
AEH	Barclays Global Aggregate Corporates - in USD abgesichert		5,70 %	3,11 %	6,22 %	6,31 %	-0,24 %	-1,77 %
AKH	Barclays Global Aggregate Corporates - in USD abgesichert		5,70 %	3,00 %	6,22 %	6,08 %	-0,24 %	-1,73 %
AU	Barclays Global Aggregate Corporates - in USD abgesichert		5,70 %	5,25 %	6,22 %	7,75 %	-0,24 %	-0,98 %
AUP	Barclays Global Aggregate Corporates - in USD abgesichert		5,70 %	6,26 %	6,22 %	8,55 %	-0,24 %	-0,98 %
DEC	Barclays Global Aggregate Corporates - in USD abgesichert	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. April 2017	3,48 %	1,10 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
DEH	Barclays Global Aggregate Corporates - in USD abgesichert		5,70 %	2,47 %	6,22 %	5,84 %	-0,24 %	-2,07 %
DU	Barclays Global Aggregate Corporates - in USD abgesichert	Wertentwicklung seit Auflegung am 25. Juli 2016	5,70 %	4,49 %	-1,41 %	-2,00 %	k. A.	k. A.
DUP	Barclays Global Aggregate Corporates - in USD abgesichert	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. April 2017	3,48 %	2,69 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IEH	Barclays Global Aggregate Corporates - in USD abgesichert		5,70 %	3,62 %	6,22 %	6,94 %	-0,24 %	-1,08 %
IGH	Barclays Global Aggregate Corporates - in USD abgesichert		5,70 %	4,36 %	6,22 %	8,15 %	-0,24 %	-0,29 %
IKH	Barclays Global Aggregate Corporates - in USD abgesichert		5,70 %	3,35 %	6,22 %	6,71 %	-0,24 %	-1,14 %
IU	Barclays Global Aggregate Corporates - in USD abgesichert		5,70 %	5,54 %	6,22 %	8,46 %	-0,24 %	-0,49 %
ZEH	Barclays Global Aggregate Corporates - in USD abgesichert	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. April 2017	3,48 %	1,79 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZGH	Barclays Global Aggregate Corporates - in USD abgesichert		5,70 %	4,38 %	6,22 %	7,87 %	-0,24 %	-0,49 %
ZU	Barclays Global Aggregate Corporates - in USD abgesichert		5,70 %	5,65 %	6,22 %	8,29 %	-0,24 %	-0,69 %
Threadneedle (Lux) - European Social Bond*								
IE	Merrill Lynch Euro Non-sovereign Index (50 %) und Merrill Lynch Euro Corp Euroland Issuers Index (50 %)	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. Mai 2017	1,53 %	1,30 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IEP	Merrill Lynch Euro Non-sovereign Index (50 %) und Merrill Lynch Euro Corp Euroland Issuers Index (50 %)	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. Mai 2017	1,53 %	1,34 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IFH	Merrill Lynch Euro Non-sovereign Index (50 %) und Merrill Lynch Euro Corp Euroland Issuers Index (50 %)	Wertentwicklung seit Auflegung am 15. Juni 2017	0,78 %	0,30 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Entwicklung berücksichtigt alle geltenden Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2017 (sie berücksichtigt jedoch nicht eine Verkaufsgebühr, wie sie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses aufgeführt ist). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse ab und ist von den geltenden Vermögensverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Erlöse werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

*Siehe Erläuterung 1.

Performance der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name des Vergleichsindex	Kommentare	31. Dezember 2017		31. Dezember 2016		31. Dezember 2015	
			Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - European Social Bond*								
<i>(Fortsetzung)</i>								
LE	Merrill Lynch Euro Non-sovereign Index (50 %) und Merrill Lynch Euro Corp Euroland Issuers Index (50 %)	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. Mai 2017	1,53%	1,40%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZE	Merrill Lynch Euro Non-sovereign Index (50 %) und Merrill Lynch Euro Corp Euroland Issuers Index (50 %)	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. Mai 2017	1,53%	1,30%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZFH	Merrill Lynch Euro Non-sovereign Index (50 %) und Merrill Lynch Euro Corp Euroland Issuers Index (50 %)	Wertentwicklung seit Auflegung am 15. Juni 2017	0,78%	0,30%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond								
AE	ML EMU Investment Grade Large Cap 3-5 Yr		0,47%	1,14%	1,89%	1,71%	1,11%	0,11%
AEP	ML EMU Investment Grade Large Cap 3-5 Yr		0,47%	1,13%	1,89%	1,65%	1,11%	0,19%
DE	ML EMU Investment Grade Large Cap 3-5 Yr		0,47%	0,56%	1,89%	1,13%	1,11%	-0,41%
DEP	ML EMU Investment Grade Large Cap 3-5 Yr		0,47%	0,51%	1,89%	1,15%	1,11%	-0,46%
IE	ML EMU Investment Grade Large Cap 3-5 Yr		0,47%	1,74%	1,89%	2,26%	1,11%	0,63%
W	ML EMU Investment Grade Large Cap 3-5 Yr		0,47%	1,16%	1,89%	1,71%	1,11%	0,24%
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds								
AEC	JPM CEMBI Broad Diversified		7,96%	6,25%	9,65%	7,78%	1,30%	-1,57%
AEH	JPM CEMBI Broad Diversified		7,96%	6,22%	9,65%	7,78%	1,30%	-1,54%
ASH	JPM CEMBI Broad Diversified		7,96%	7,79%	9,65%	9,50%	1,30%	-0,62%
AU	JPM CEMBI Broad Diversified		7,96%	8,42%	9,65%	9,26%	1,30%	-1,30%
AUP	JPM CEMBI Broad Diversified		7,96%	8,39%	9,65%	9,33%	1,30%	-1,23%
BU	JPM CEMBI Broad Diversified	Wertentwicklung seit Auflegung am 7. November 2017	0,26%	0,20%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
BUP	JPM CEMBI Broad Diversified	Wertentwicklung seit Auflegung am 7. November 2017	0,26%	0,20%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
DEC	JPM CEMBI Broad Diversified		7,96%	5,60%	9,65%	7,16%	1,30%	-2,06%
DEH	JPM CEMBI Broad Diversified		7,96%	5,56%	9,65%	7,13%	1,30%	-2,10%
DU	JPM CEMBI Broad Diversified		7,96%	7,71%	9,65%	8,66%	1,30%	-1,77%
IEH	JPM CEMBI Broad Diversified		7,96%	6,91%	9,65%	8,54%	1,30%	-0,79%
p	JPM CEMBI Broad Diversified	Wertentwicklung bis zur Schließung am 21. Juni 2017	5,06%	5,12%	9,65%	9,71%	1,30%	-0,84%
W	JPM CEMBI Broad Diversified		7,96%	8,79%	9,65%	9,77%	1,30%	-0,80%
WEH	JPM CEMBI Broad Diversified		7,96%	6,61%	9,65%	8,23%	1,30%	-1,06%
XUP	JPM CEMBI Broad Diversified	Wertentwicklung seit Auflegung am 15. Dezember 2016	7,96%	10,06%	0,78%	0,40%	k. A.	k. A.

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Entwicklung berücksichtigt alle geltenden Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2017 (sie berücksichtigt jedoch nicht eine Verkaufsgebühr, wie sie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses aufgeführt ist). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Vermögensverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Erlöse werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

*Siehe Erläuterung 1.

Performance der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name des Vergleichsindex	Kommentare	31. Dezember 2017		31. Dezember 2016		31. Dezember 2015	
			Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt								
AEC	JPM EMBI Global		9,32%	7,66%	10,19%	9,46%	1,23%	-3,16%
AEH	JPM EMBI Global		9,32%	7,64%	10,19%	9,34%	1,23%	-3,05%
ASH	JPM EMBI Global		9,32%	9,25%	10,19%	11,18%	1,23%	-2,15%
AU	JPM EMBI Global		9,32%	9,86%	10,19%	11,01%	1,23%	-2,82%
AUP	JPM EMBI Global		9,32%	9,89%	10,19%	11,03%	1,23%	-2,84%
DEH	JPM EMBI Global		9,32%	6,91%	10,19%	8,77%	1,23%	-3,62%
DU	JPM EMBI Global		9,32%	9,17%	10,19%	10,37%	1,23%	-3,31%
IEH	JPM EMBI Global		9,32%	8,20%	10,19%	9,64%	1,23%	-2,34%
SU	JPM EMBI Global		9,32%	9,70%	10,19%	10,93%	1,23%	-2,83%
SUP	JPM EMBI Global		9,32%	9,76%	10,19%	10,96%	1,23%	-2,82%
W	JPM EMBI Global		9,32%	10,25%	10,19%	11,49%	1,23%	-2,33%
XUP	JPM EMBI Global	Wertentwicklung seit Auflegung am 15. Dezember 2016	9,32%	11,63%	0,55%	0,60%	k. A.	k. A.
ZU	JPM EMBI Global		9,32%	10,64%	10,19%	11,90%	1,23%	-2,08%
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds								
AEC	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		4,71%	3,92%	8,55%	6,35%	3,29%	0,40%
AEH	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		4,71%	3,95%	8,55%	6,26%	3,29%	0,29%
ASC	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		4,71%	5,53%	8,55%	7,88%	3,29%	1,49%
ASH	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		4,71%	5,48%	8,55%	8,00%	3,29%	1,37%
AU	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		4,71%	6,09%	8,55%	7,74%	3,29%	0,79%
AUP	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		4,71%	6,05%	8,55%	7,81%	3,29%	0,78%
BU	JPM EMBI Global 3-5 Yrs	Wertentwicklung seit Auflegung am 7. November 2017	0,11%	0,10%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
BUP	JPM EMBI Global 3-5 Yrs	Wertentwicklung seit Auflegung am 7. November 2017	0,11%	0,10%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
DEH	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		4,71%	3,75%	8,55%	6,06%	3,29%	0,18%
DU	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		4,71%	5,82%	8,55%	7,51%	3,29%	0,67%
IEH	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		4,71%	4,59%	8,55%	6,92%	3,29%	1,05%
W	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		4,71%	6,32%	8,55%	7,95%	3,29%	1,03%
ZEH	JPM EMBI Global 3-5 Yrs	Wertentwicklung seit Auflegung am 15. März 2016	4,71%	4,80%	7,14%	6,20%	k. A.	k. A.
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond								
AEC	ML US High Yield Cash Pay Constrained		6,97%	3,71%	14,79%	9,18%	-2,89%	-1,29%
AEH	ML US High Yield Cash Pay Constrained		6,97%	3,72%	14,79%	9,04%	-2,89%	-1,28%
ASH	ML US High Yield Cash Pay Constrained		6,97%	5,28%	14,79%	10,74%	-2,89%	-0,34%
AU	ML US High Yield Cash Pay Constrained		6,97%	5,83%	14,79%	10,53%	-2,89%	-0,98%
AUP	ML US High Yield Cash Pay Constrained		6,97%	5,80%	14,79%	10,60%	-2,89%	-1,02%
BU	ML US High Yield Cash Pay Constrained	Wertentwicklung seit Auflegung am 7. November 2017	0,02%	-0,30%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
BUP	ML US High Yield Cash Pay Constrained	Wertentwicklung seit Auflegung am 7. November 2017	0,02%	-0,30%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
DEC	ML US High Yield Cash Pay Constrained		6,97%	2,74%	14,79%	8,06%	-2,89%	-2,34%

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Entwicklung berücksichtigt alle geltenden Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2017 (sie berücksichtigt jedoch nicht eine Verkaufsgebühr, wie sie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses aufgeführt ist). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Vermögensverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Erlöse werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Performance der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name des Vergleichsindex	Kommentare	31. Dezember 2017		31. Dezember 2016		31. Dezember 2015	
			Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond								
<i>(Fortsetzung)</i>								
DEH	ML US High Yield Cash Pay Constrained		6,97%	2,68%	14,79%	7,98%	-2,89%	-2,29%
DU	ML US High Yield Cash Pay Constrained		6,97%	4,75%	14,79%	9,49%	-2,89%	-1,96%
IEC	ML US High Yield Cash Pay Constrained	Wertentwicklung seit Auflegung am 13. Juli 2017	2,35%	1,00%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IEH	ML US High Yield Cash Pay Constrained		6,97%	4,67%	14,79%	9,97%	-2,89%	-0,73%
TEH	ML US High Yield Cash Pay Constrained	Wertentwicklung seit Auflegung am 9. November 2016	7,47%	4,66%	1,89%	0,80%	k. A.	k. A.
XUP	ML US High Yield Cash Pay Constrained	Wertentwicklung seit Auflegung am 9. November 2016	7,47%	7,33%	1,89%	1,20%	k. A.	k. A.
ZGH	ML US High Yield Cash Pay Constrained	Wertentwicklung seit Auflegung am 8. Juli 2016	7,47%	5,21%	6,47%	3,70%	k. A.	k. A.
ZU	ML US High Yield Cash Pay Constrained		6,97%	6,42%	14,79%	11,27%	-2,89%	-0,30%
Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond								
AEH	Barclays U.S. Corporate Investment Grade Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 5. August 2016	6,42%	2,90%	-2,47%	-3,30%	k. A.	k. A.
AU	Barclays U.S. Corporate Investment Grade Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 5. August 2016	6,42%	5,03%	-2,47%	-2,60%	k. A.	k. A.
DEH	Barclays U.S. Corporate Investment Grade Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 5. August 2016	6,42%	2,48%	-2,47%	-3,40%	k. A.	k. A.
DU	Barclays U.S. Corporate Investment Grade Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 5. August 2016	6,42%	4,62%	-2,47%	-2,70%	k. A.	k. A.
IEC	Barclays U.S. Corporate Investment Grade Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 5. August 2016	6,42%	3,59%	-2,47%	-3,10%	k. A.	k. A.
IEH	Barclays U.S. Corporate Investment Grade Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 5. August 2016	6,42%	3,51%	-2,47%	-3,00%	k. A.	k. A.
IFH	Barclays U.S. Corporate Investment Grade Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 5. August 2016	6,42%	3,00%	-2,47%	-3,20%	k. A.	k. A.
IU	Barclays U.S. Corporate Investment Grade Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 5. August 2016	6,42%	5,63%	-2,47%	-2,30%	k. A.	k. A.
IUP	Barclays U.S. Corporate Investment Grade Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 5. August 2016	6,42%	5,62%	-2,47%	-2,30%	k. A.	k. A.
XUP	Barclays U.S. Corporate Investment Grade Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 15. Dezember 2016	6,42%	9,40%	1,05%	1,20%	k. A.	k. A.
ZEH	Barclays U.S. Corporate Investment Grade Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 5. August 2016	6,42%	3,30%	-2,47%	-3,10%	k. A.	k. A.
ZFH	Barclays U.S. Corporate Investment Grade Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 13. Juli 2017	2,38%	0,80%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZU	Barclays U.S. Corporate Investment Grade Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 5. August 2016	6,42%	5,43%	-2,47%	-2,40%	k. A.	k. A.

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Entwicklung berücksichtigt alle geltenden Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2017 (sie berücksichtigt jedoch nicht eine Verkaufsgebühr, wie sie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses aufgeführt ist). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Vermögensverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Erlöse werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Performance der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name des Vergleichsindex	Kommentare	31. Dezember 2017		31. Dezember 2016		31. Dezember 2015	
			Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond								
AEH	Gemischter Vergleichsindex		10,82%	7,33%	5,41%	4,58%	-2,73%	-3,55%
AS	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 13. Juli 2017	4,43%	0,90%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ASC	Gemischter Vergleichsindex		10,82%	8,84%	5,41%	6,22%	-2,73%	-2,67%
ASH	Gemischter Vergleichsindex		10,82%	8,83%	5,41%	6,11%	-2,73%	-2,59%
AU	Gemischter Vergleichsindex		10,82%	9,44%	5,41%	6,15%	-2,73%	-3,26%
AUP	Gemischter Vergleichsindex		10,82%	9,70%	5,41%	6,12%	-2,73%	-3,16%
AVC	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 13. Juli 2017	4,43%	4,10%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
AVH	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 13. Juli 2017	4,43%	4,10%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
DEH	Gemischter Vergleichsindex		10,82%	6,66%	5,41%	4,02%	-2,73%	-3,95%
IEH	Gemischter Vergleichsindex		10,82%	7,80%	5,41%	5,03%	-2,73%	-3,06%
IGH	Gemischter Vergleichsindex		10,82%	8,66%	5,41%	6,16%	-2,73%	-2,39%
ISH	Gemischter Vergleichsindex		10,82%	9,42%	5,41%	6,74%	-2,73%	-2,01%
IU	Gemischter Vergleichsindex		10,82%	10,13%	5,41%	6,68%	-2,73%	-2,58%
XU	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 15. Dezember 2016	10,82%	11,04%	-0,80%	-0,80%	k. A.	k. A.
ZU	Gemischter Vergleichsindex		10,82%	10,19%	5,41%	6,87%	-2,73%	-2,58%
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation								
AEC	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE		k. A.	11,14%	k. A.	-2,86%	k. A.	-1,02%
AEH	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE		k. A.	11,13%	k. A.	-2,84%	k. A.	-1,19%
AU	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE		k. A.	13,46%	k. A.	-1,41%	k. A.	-0,74%
AUP	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE		k. A.	13,54%	k. A.	-1,43%	k. A.	-0,76%
BU	40 % JPM GBI Global (Traded)(USD Unhedged), 60 % MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 7. November 2017	2,41%	0,90%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
DEH	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE		k. A.	10,14%	k. A.	-3,68%	k. A.	-1,88%
DU	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE		k. A.	12,48%	k. A.	-2,24%	k. A.	-1,47%
IGH	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE		k. A.	12,87%	k. A.	-1,32%	k. A.	0,34%
IU	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE		k. A.	14,33%	k. A.	-0,67%	k. A.	0,13%
W	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE		k. A.	13,43%	k. A.	-1,41%	k. A.	-0,61%
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income								
AE	US 3 Month Libor	Wertentwicklung seit Auflegung am 13. Juli 2017	0,65%	-0,30%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
AEC	US 3 Month Libor		1,26%	9,58%	0,75%	3,80%	0,32%	2,02%
AEH	US 3 Month Libor		1,26%	9,47%	0,75%	3,90%	0,32%	2,02%
AEP	US 3 Month Libor	Wertentwicklung seit Auflegung am 14. Oktober 2015	1,26%	-1,91%	0,75%	8,59%	0,09%	5,85%
AU	US 3 Month Libor		1,26%	11,68%	0,75%	5,50%	0,32%	2,39%
AUP	US 3 Month Libor	Wertentwicklung seit Auflegung am 14. Oktober 2015	1,26%	11,70%	0,75%	5,48%	0,09%	0,60%
DEC	US 3 Month Libor		1,26%	8,62%	0,75%	3,15%	0,32%	1,16%

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Entwicklung berücksichtigt alle geltenden Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2017 (sie berücksichtigt jedoch nicht eine Verkaufsgebühr, wie sie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses aufgeführt ist). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Vermögensverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Erlöse werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Performance der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse Name des Vergleichsindex	Kommentare	31. Dezember 2017		31. Dezember 2016		31. Dezember 2015		
		Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income								
<i>(Fortsetzung)</i>								
DEH US 3 Month Libor	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. April 2017	0,91%	4,60%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	
DEP US 3 Month Libor	Wertentwicklung seit Auflegung am 14. Oktober 2015	1,26%	-2,63%	0,75%	7,87%	0,09%	5,72%	
DU US 3 Month Libor		1,26%	10,87%	0,75%	4,71%	0,32%	1,60%	
DUP US 3 Month Libor		1,26%	10,81%	0,75%	4,68%	0,32%	1,72%	
ZE US 3 Month Libor	Wertentwicklung seit Auflegung am 13. Juli 2017	0,65%	0,00%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	
ZEC US 3 Month Libor	Wertentwicklung bis zur Schließung am 5. August 2016 für das Jahr 2016 und seit dem 25. April 2017 für das Jahr 2017	0,92%	5,88%	0,75%	k. A.	0,32%	2,48%	
ZEH US 3 Month Libor	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. April 2017	0,91%	5,50%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	
ZU US 3 Month Libor	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. April 2017	0,91%	6,90%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	
Threadneedle (Lux) - Global Focus								
AEH MSCI AC World		24,62%	27,75%	8,48%	-2,70%	-1,84%	1,61%	
AEP MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 8. Juli 2016	24,62%	14,63%	7,38%	0,95%	k. A.	k. A.	
AU MSCI AC World		24,62%	30,50%	8,48%	-1,15%	-1,84%	1,39%	
BU MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 7. November 2017	3,06%	1,40%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	
DEH MSCI AC World		24,62%	26,84%	8,48%	-3,41%	-1,84%	0,86%	
DU MSCI AC World		24,62%	29,57%	8,48%	-1,92%	-1,84%	0,67%	
IE MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. April 2017	14,58%	2,58%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	
IU MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. April 2017	14,58%	13,23%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	
W MSCI AC World		24,62%	30,64%	8,48%	-1,05%	-1,84%	1,50%	
XU MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 8. Juli 2016	24,62%	32,68%	7,38%	-3,00%	k. A.	k. A.	
ZE MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 8. Juli 2016	24,62%	15,50%	7,38%	1,30%	k. A.	k. A.	
ZEP MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 8. Juli 2016	24,62%	15,50%	7,38%	1,22%	k. A.	k. A.	
ZG MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 8. Juli 2016	24,62%	20,10%	7,38%	1,00%	k. A.	k. A.	
ZU MSCI AC World		24,62%	31,49%	8,48%	-0,47%	1,81%	2,13%	
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities								
AEH MSCI Global Emerging Markets Free		37,75%	28,98%	11,60%	4,32%	-14,60%	-16,38%	
AU MSCI Global Emerging Markets Free		37,75%	31,86%	11,60%	5,94%	-14,60%	-16,45%	
DEH MSCI Global Emerging Markets Free		37,75%	27,76%	11,60%	3,29%	-14,60%	-17,28%	
DU MSCI Global Emerging Markets Free		37,75%	30,54%	11,60%	4,88%	-14,60%	-17,31%	
IEH MSCI Global Emerging Markets Free		37,75%	29,95%	11,60%	5,02%	-14,60%	-15,72%	
W MSCI Global Emerging Markets Free	Wertentwicklung bis zur Schließung am 6. Januar 2017	14,05%	7,56%	14,05%	7,56%	-14,60%	-16,58%	
ZU MSCI Global Emerging Markets Free		37,75%	32,80%	11,60%	6,77%	-14,60%	-15,79%	

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Entwicklung berücksichtigt alle geltenden Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2017 (sie berücksichtigt jedoch nicht eine Verkaufsgebühr, wie sie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses aufgeführt ist). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Vermögensverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Erlöse werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Performance der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name des Vergleichsindex	Kommentare	31. Dezember 2017		31. Dezember 2016		31. Dezember 2015	
			Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies								
AE	MSCI W Small Cap		8,20%	18,44%	16,64%	5,83%	11,52%	14,23%
AGH	MSCI W Small Cap		8,20%	19,18%	16,64%	5,87%	11,52%	13,72%
DE	MSCI W Small Cap		8,20%	17,87%	16,64%	5,26%	11,52%	13,69%
IE	MSCI W Small Cap		8,20%	19,60%	16,64%	6,74%	11,52%	15,23%
IGH	MSCI W Small Cap		8,20%	20,30%	16,64%	6,86%	11,52%	14,74%
XGH	MSCI W Small Cap	Wertentwicklung seit Auflegung am 15. Dezember 2016	8,20%	21,28%	1,14%	2,70%	k. A.	k. A.
ZGH	MSCI W Small Cap		8,20%	20,07%	16,64%	6,79%	11,52%	14,68%
Threadneedle (Lux) - American								
AEH	S&P 500		21,83%	22,37%	11,96%	3,78%	1,38%	1,71%
AU	S&P 500		21,83%	24,80%	11,96%	5,08%	1,38%	1,61%
BU	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 7. November 2017	3,54%	2,30%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
DEH	S&P 500		21,83%	21,72%	11,96%	3,28%	1,38%	1,02%
DU	S&P 500		21,83%	24,13%	11,96%	4,57%	1,38%	1,12%
IEH	S&P 500		21,83%	23,46%	11,96%	4,70%	1,38%	2,38%
IU	S&P 500		21,83%	25,98%	11,96%	5,99%	1,38%	2,44%
W	S&P 500		21,83%	25,21%	11,96%	5,46%	1,38%	1,98%
Threadneedle (Lux) - American Select								
AEH	S&P 500		21,83%	21,21%	11,96%	6,81%	1,38%	0,14%
AU	S&P 500		21,83%	23,56%	11,96%	8,05%	1,38%	0,29%
DEH	S&P 500		21,83%	20,24%	11,96%	6,01%	1,38%	-0,66%
DU	S&P 500		21,83%	22,62%	11,96%	7,21%	1,38%	-0,44%
IEH	S&P 500		21,83%	22,13%	11,96%	7,52%	1,38%	0,88%
W	S&P 500		21,83%	23,70%	11,96%	8,12%	1,38%	0,44%
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity								
AE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 23. September 2015	37,32%	21,97%	7,06%	7,87%	3,77%	7,22%
AF	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 23. September 2015	37,32%	33,27%	7,06%	6,24%	3,77%	6,76%
AS	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 13. Juli 2017	13,27%	10,40%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ASH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		37,32%	37,63%	7,06%	4,39%	-3,84%	-1,96%
AU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		37,32%	39,10%	7,06%	4,60%	-3,84%	-2,25%
DE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 23. September 2015	37,32%	20,84%	7,06%	6,75%	3,77%	6,91%
IE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 23. September 2015	37,32%	22,93%	7,06%	8,51%	3,77%	7,42%
IF	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 23. September 2015	37,32%	34,22%	7,06%	6,98%	3,77%	6,96%
ISH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		37,32%	38,99%	7,06%	5,12%	-3,84%	-1,26%
IU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		37,32%	39,93%	7,06%	5,43%	-3,84%	-1,56%
XUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 15. Dezember 2016	37,32%	41,33%	-2,09%	-2,40%	k. A.	k. A.

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Entwicklung berücksichtigt alle geltenden Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2017 (sie berücksichtigt jedoch nicht eine Verkaufsgebühr, wie sie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses aufgeführt ist). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Vermögensverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Erlöse werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Performance der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name des Vergleichsindex	Kommentare	31. Dezember 2017		31. Dezember 2016		31. Dezember 2015	
			Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity								
<i>(Fortsetzung)</i>								
ZE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 23. September 2015	37,32%	22,89%	7,06%	8,60%	3,77%	7,52%
ZEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		37,32%	37,01%	7,06%	3,85%	-3,84%	-1,46%
ZF	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 23. September 2015	37,32%	34,27%	7,06%	6,97%	3,77%	7,06%
ZU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		37,32%	40,02%	7,06%	5,43%	-3,84%	-1,56%
Threadneedle (Lux) - Asian Focus								
AE	MSCI AC Asia ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 25. September 2015	42,08%	27,15%	5,76%	3,72%	3,34%	7,06%
AF	MSCI AC Asia ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 25. September 2015	42,08%	38,81%	5,76%	2,34%	3,34%	6,57%
AS	MSCI AC Asia ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 13. Juli 2017	13,85%	10,80%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ASH	MSCI AC Asia ex Japan		42,08%	43,86%	5,76%	0,49%	-5,32%	-3,41%
AU	MSCI AC Asia ex Japan		42,08%	44,73%	5,76%	0,69%	-5,32%	-3,78%
DE	MSCI AC Asia ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 25. September 2015	42,08%	25,86%	5,76%	2,70%	3,34%	6,77%
DEH	MSCI AC Asia ex Japan		42,08%	40,24%	5,76%	-1,80%	-5,32%	-4,57%
IE	MSCI AC Asia ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 25. September 2015	42,08%	28,09%	5,76%	4,36%	3,34%	7,26%
IF	MSCI AC Asia ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 25. September 2015	42,08%	39,76%	5,76%	2,99%	3,34%	6,77%
ISH	MSCI AC Asia ex Japan		42,08%	44,89%	5,76%	1,26%	-5,32%	-2,64%
IU	MSCI AC Asia ex Japan		42,08%	45,84%	5,76%	1,46%	-5,32%	-3,01%
XUP	MSCI AC Asia ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 15. Dezember 2016	42,08%	49,92%	-2,06%	-1,90%	k. A.	k. A.
ZE	MSCI AC Asia ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 25. September 2015	42,08%	28,04%	5,76%	4,45%	3,34%	7,36%
ZEH	MSCI AC Asia ex Japan		42,08%	42,72%	5,76%	-0,10%	-5,32%	-2,83%
ZF	MSCI AC Asia ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 25. September 2015	42,08%	39,91%	5,76%	2,98%	3,34%	6,87%
ZU	MSCI AC Asia ex Japan		42,08%	45,88%	5,76%	1,46%	-5,32%	-3,11%
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income								
AE	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2015	32,75%	18,47%	3,98%	1,69%	3,79%	8,34%
AEP	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2015	32,75%	18,47%	3,98%	4,88%	3,79%	8,34%
AF	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2015	32,75%	29,26%	3,98%	0,19%	3,79%	7,72%
AFP	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2015	32,75%	29,26%	3,98%	3,32%	3,79%	7,72%
ASC	Gemischter Vergleichsindex		32,75%	33,89%	3,98%	-1,55%	-4,67%	-2,58%
ASH	Gemischter Vergleichsindex		32,75%	33,84%	3,98%	-1,49%	-4,67%	-2,43%
ASP	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 13. Juli 2017	12,70%	9,30%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
AU	Gemischter Vergleichsindex		32,75%	34,87%	3,98%	-1,29%	-4,67%	-2,69%
AUP	Gemischter Vergleichsindex		32,75%	34,78%	3,98%	-1,31%	-4,67%	-2,64%
AVC	Gemischter Vergleichsindex		32,75%	34,78%	3,98%	-1,25%	-4,67%	-1,49%

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Entwicklung berücksichtigt alle geltenden Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2017 (sie berücksichtigt jedoch nicht eine Verkaufsgebühr, wie sie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses aufgeführt ist). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Vermögensverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Erlöse werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Performance der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name des Vergleichsindex	Kommentare	31. Dezember 2017		31. Dezember 2016		31. Dezember 2015	
			Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income								
<i>(Fortsetzung)</i>								
AVH	Gemischter Vergleichsindex		32,75%	34,97%	3,98%	-1,16%	-4,67%	-1,45%
DE	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2015	32,75%	17,20%	3,98%	0,75%	3,79%	8,04%
IE	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2015	32,75%	19,32%	3,98%	2,34%	3,79%	8,55%
IEP	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2015	32,75%	19,32%	3,98%	5,54%	3,79%	8,55%
IF	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2015	32,75%	30,10%	3,98%	0,94%	3,79%	7,92%
IFP	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2015	32,75%	30,10%	3,98%	4,10%	3,79%	7,92%
ISH	Gemischter Vergleichsindex		32,75%	34,85%	3,98%	-0,79%	-4,67%	-1,74%
IU	Gemischter Vergleichsindex		32,75%	35,72%	3,98%	-0,49%	-4,67%	-1,92%
IUP	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2015	32,75%	35,69%	3,98%	2,23%	3,79%	4,72%
ZE	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2015	32,75%	19,29%	3,98%	2,53%	3,79%	8,55%
ZEH	Gemischter Vergleichsindex		32,75%	33,00%	3,98%	-2,17%	-4,67%	-1,93%
ZEP	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2015	32,75%	19,29%	3,98%	5,74%	3,79%	8,55%
ZF	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2015	32,75%	30,17%	3,98%	1,03%	3,79%	7,92%
ZFP	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2015	32,75%	30,17%	3,98%	4,19%	3,79%	7,92%
ZU	Gemischter Vergleichsindex		32,75%	35,72%	3,98%	-0,49%	-4,67%	-1,92%
ZUP	Gemischter Vergleichsindex	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2015	32,75%	35,75%	3,98%	2,62%	3,79%	4,42%
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities								
AEC	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 30. September 2015	21,83%	17,29%	11,96%	6,52%	9,09%	9,10%
AEH	S&P 500		21,83%	17,30%	11,96%	5,61%	1,38%	0,30%
ASH	S&P 500	Wertentwicklung bis zur Schließung am 25. August 2017	3,78%	9,68%	11,96%	6,91%	1,38%	1,06%
AU	S&P 500		21,83%	19,65%	11,96%	6,96%	1,38%	0,45%
AUP	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 30. September 2015	21,83%	19,67%	11,96%	6,92%	9,09%	8,90%
DU	S&P 500		21,83%	19,06%	11,96%	6,43%	1,38%	-0,07%
IFH	S&P 500		21,83%	17,85%	11,96%	5,56%	1,38%	0,62%
IU	S&P 500		21,83%	20,62%	11,96%	7,81%	1,38%	1,22%
XS	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 14. Dezember 2016	21,83%	12,75%	-1,36%	1,30%	k. A.	k. A.
XSH	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 14. Dezember 2016	21,83%	21,08%	-1,36%	-0,20%	k. A.	k. A.
ZEH	S&P 500		21,83%	18,18%	11,96%	6,38%	1,38%	0,98%
ZFH	S&P 500		21,83%	17,81%	11,96%	5,63%	1,38%	0,59%
ZGH	S&P 500		21,83%	19,17%	11,96%	6,93%	1,38%	1,37%
ZU	S&P 500		21,83%	20,52%	11,96%	7,83%	1,38%	1,07%

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Entwicklung berücksichtigt alle geltenden Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2017 (sie berücksichtigt jedoch nicht eine Verkaufsgebühr, wie sie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses aufgeführt ist). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Vermögensverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Erlöse werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Performance der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name des Vergleichsindex	Kommentare	31. Dezember 2017		31. Dezember 2016		31. Dezember 2015	
			Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities*								
AE	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Juni 2017	10,83%	5,20%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
AEH	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Juni 2017	10,83%	12,00%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
AU	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Juni 2017	10,83%	13,30%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
AUP	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Juni 2017	10,83%	13,35%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
DE	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Juni 2017	10,83%	5,10%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
DEH	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Juni 2017	10,83%	11,90%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
DU	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Juni 2017	10,83%	13,20%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IE	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Juni 2017	10,83%	5,40%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IEC	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Juni 2017	10,83%	11,70%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IEH	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Juni 2017	10,83%	12,20%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IFH	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Juni 2017	10,83%	12,10%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IU	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Juni 2017	10,83%	13,50%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZEH	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Juni 2017	10,83%	12,20%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZFH	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Juni 2017	10,83%	12,00%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZU	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Juni 2017	10,83%	13,50%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities								
AE	MSCI Europe Gross		10,88%	9,23%	3,22%	-3,58%	8,78%	12,04%
ASH	MSCI Europe Gross		10,88%	10,64%	3,22%	-2,56%	8,78%	11,88%
AUH	MSCI Europe Gross		10,88%	11,06%	3,22%	-2,74%	8,78%	10,89%
BUH	MSCI Europe Gross	Wertentwicklung seit Auflegung am 7. November 2017	-1,64%	-3,00%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
DE	MSCI Europe Gross		10,88%	8,40%	3,22%	-4,30%	8,78%	11,20%
IE	MSCI Europe Gross		10,88%	10,15%	3,22%	-2,77%	8,78%	12,93%
W	MSCI Europe Gross		10,88%	9,31%	3,22%	-3,47%	8,78%	12,14%
XE	MSCI Europe Gross		10,88%	11,08%	3,22%	-1,94%		
ZUH	MSCI Europe Gross		10,88%	11,97%	3,22%	-2,01%	8,78%	11,74%
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities								
AE	HSBC Smaller Pan European (EUR)		17,69%	23,54%	2,81%	-1,06%	21,76%	28,48%
ASH	HSBC Smaller Pan European (EUR)		17,69%	25,16%	2,81%	0,10%	21,76%	28,14%
DE	HSBC Smaller Pan European (EUR)		17,69%	22,46%	2,81%	-1,97%	21,76%	27,35%
IE	HSBC Smaller Pan European (EUR)		17,69%	24,47%	2,81%	-0,35%	21,76%	29,47%
W	HSBC Smaller Pan European (EUR)		17,69%	23,47%	2,81%	-1,13%	21,76%	28,43%

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Entwicklung berücksichtigt alle geltenden Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2017 (sie berücksichtigt jedoch nicht eine Verkaufsgebühr, wie sie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses aufgeführt ist). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Vermögensverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Erlöse werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

*Siehe Erläuterung 1.

Performance der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name des Vergleichsindex	Kommentare	31. Dezember 2017		31. Dezember 2016		31. Dezember 2015	
			Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - European Select								
AE	FTSE W Europe ex UK		13,01%	13,92%	3,35%	-3,34%	10,92%	16,16%
AGH	FTSE W Europe ex UK		13,01%	15,25%	3,35%	-2,57%	10,92%	16,32%
AUH	FTSE W Europe ex UK		13,01%	16,39%	3,35%	-1,73%	10,92%	15,53%
IE	FTSE W Europe ex UK		13,01%	14,92%	3,35%	-2,46%	10,92%	17,13%
ZG	FTSE W Europe ex UK	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. April 2017	2,82%	8,90%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZGH	FTSE W Europe ex UK		13,01%	15,50%	3,35%	-2,24%	10,92%	16,52%
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income								
AEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		37,32%	31,16%	7,06%	7,52%	-9,12%	-11,97%
AU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		37,32%	34,00%	7,06%	9,08%	-9,12%	-12,03%
AUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. April 2017	8,65%	22,42%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
DEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		37,32%	29,87%	7,06%	6,45%	-9,12%	-12,84%
DU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		37,32%	32,68%	7,06%	8,00%	-9,12%	-12,91%
DUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. April 2017	8,65%	21,60%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IEP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. April 2017	8,65%	11,46%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
W	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		37,32%	33,82%	7,06%	8,91%	-9,12%	-12,16%
ZGH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		37,32%	33,05%	7,06%	9,05%	-9,12%	-11,16%
ZUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. Mai 2016	37,32%	34,90%	7,99%	5,00%	k. A.	k. A.
Threadneedle (Lux) - Greater China Equities								
AEH	MSCI Golden Dragon		44,19%	49,73%	5,75%	0,34%	-7,12%	-7,39%
AU	MSCI Golden Dragon		44,19%	53,09%	5,75%	1,70%	-7,12%	-8,07%
DEH	MSCI Golden Dragon		44,19%	48,31%	5,75%	-0,59%	-7,12%	-8,21%
DU	MSCI Golden Dragon		44,19%	51,58%	5,75%	0,68%	-7,12%	-8,98%
W	MSCI Golden Dragon		44,19%	52,87%	5,75%	1,52%	-7,12%	-8,17%
Threadneedle (Lux) - Global Energy Equities*								
AEH	MSCI World - Energy Gross		2,02%	0,04%	27,57%	21,53%	-22,17%	-23,49%
AU	MSCI World - Energy Gross		2,02%	2,07%	27,57%	23,13%	-22,17%	-23,30%
DEH	MSCI World - Energy Gross		2,02%	-0,53%	27,57%	20,97%	-22,17%	-24,03%
DU	MSCI World - Energy Gross		2,02%	1,44%	27,57%	22,45%	-22,17%	-23,69%
W	MSCI World - Energy Gross		2,02%	2,31%	27,57%	23,47%	-22,17%	-23,03%
Threadneedle (Lux) - Global Technology								
AEH	MSCI World IT Index		38,74%	31,08%	11,98%	13,35%	5,21%	8,03%
AS	MSCI World IT Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 13. Juli 2017	14,65%	4,60%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
AU	MSCI World IT Index		38,74%	33,81%	11,98%	14,59%	5,21%	7,74%
BU	MSCI World IT Index		38,74%	33,32%	11,98%	14,24%	5,21%	7,48%
DU	MSCI World IT Index		38,74%	33,34%	11,98%	14,22%	5,21%	7,48%

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Entwicklung berücksichtigt alle geltenden Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2017 (sie berücksichtigt jedoch nicht eine Verkaufsgebühr, wie sie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses aufgeführt ist). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Vermögensverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Erlöse werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

*Siehe Erläuterung 1.

Performance der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name des Vergleichsindex	Kommentare	31. Dezember 2017		31. Dezember 2016		31. Dezember 2015	
			Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Global Technology								
<i>(Fortsetzung)</i>								
IEH	MSCI World IT Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 21. Juni 2017	16,55%	9,20%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZFH	MSCI World IT Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 13. Juli 2017	14,65%	7,00%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZU	MSCI World IT Index		38,74%	34,89%	11,98%	15,55%	5,21%	8,69%
Threadneedle (Lux) - UK Equities								
AEH	FTSE All Share		13,10%	8,60%	16,75%	12,07%	0,98%	5,38%
AFH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. April 2017	9,13%	3,21%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
AG	FTSE All Share		13,10%	9,93%	16,75%	12,87%	0,98%	5,48%
AGP	FTSE All Share		13,10%	9,93%	16,75%	12,87%	0,98%	5,49%
DEH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 13. Juli 2017	6,03%	2,61%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
DG	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 13. Juli 2017	6,03%	2,80%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IEH	FTSE All Share		13,10%	9,60%	16,75%	12,96%	0,98%	6,17%
IG	FTSE All Share		13,10%	11,04%	16,75%	13,87%	0,98%	6,37%
IGP	FTSE All Share		13,10%	11,01%	16,75%	13,86%	0,98%	6,35%
ZEH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 14. Oktober 2015	13,10%	9,47%	16,75%	12,73%	0,90%	3,44%
ZFH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 8. März 2016	13,10%	8,96%	17,60%	12,70%	k. A.	k. A.
ZG	FTSE All Share		13,10%	10,79%	16,75%	13,68%	0,98%	6,32%
ZGP	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 14. Oktober 2015	13,10%	10,81%	16,75%	15,06%	0,90%	3,44%
ZUH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 8. März 2016	13,10%	11,69%	17,60%	14,60%	k. A.	k. A.
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income								
AE	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	2,33%	1,96%	2,80%	k. A.	k. A.
AEC	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	7,25%	1,96%	0,00%	k. A.	k. A.
AEH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	5,03%	1,96%	0,00%	k. A.	k. A.
AG	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	6,21%	1,96%	0,40%	k. A.	k. A.
ASC	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	7,31%	1,96%	0,30%	k. A.	k. A.
AUC	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	8,46%	1,96%	0,50%	k. A.	k. A.
DE	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	1,46%	1,96%	5,44%	k. A.	k. A.
DEC	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	5,91%	1,96%	-0,20%	k. A.	k. A.
DEH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	4,23%	1,96%	-0,20%	k. A.	k. A.
DG	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	5,52%	1,96%	-0,30%	k. A.	k. A.

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Entwicklung berücksichtigt alle geltenden Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2017 (sie berücksichtigt jedoch nicht eine Verkaufsgebühr, wie sie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses aufgeführt ist). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Vermögensverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Erlöse werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Performance der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name des Vergleichsindex	Kommentare	31. Dezember 2017		31. Dezember 2016		31. Dezember 2015	
			Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income								
<i>(Fortsetzung)</i>								
DGP	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	9,65%	1,96%	0,20%	k. A.	k. A.
IE	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	3,20%	1,96%	3,00%	k. A.	k. A.
IEH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	5,91%	1,96%	-0,20%	k. A.	k. A.
IG	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	7,39%	1,96%	1,21%	k. A.	k. A.
IGP	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	7,35%	1,96%	0,10%	k. A.	k. A.
IU	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	17,53%	1,96%	-3,00%	k. A.	k. A.
IUH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. April 2017	9,13%	3,20%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
LG	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	7,59%	1,96%	0,10%	k. A.	k. A.
LGP	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	7,44%	1,96%	0,20%	k. A.	k. A.
ZE	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	3,01%	1,96%	4,67%	k. A.	k. A.
ZEH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	6,33%	1,96%	0,20%	k. A.	k. A.
ZFH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	5,32%	1,96%	0,10%	k. A.	k. A.
ZG	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	7,20%	1,96%	0,50%	k. A.	k. A.
ZGP	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	11,38%	1,96%	0,50%	k. A.	k. A.
ZUH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Oktober 2016	13,10%	7,78%	1,96%	0,70%	k. A.	k. A.
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity								
IU	MSCI EFM(ex South Africa) Free Float		22,81%	17,10%	-7,43%	-12,88%	-11,19%	-23,40%
ZU	MSCI EFM(ex South Africa) Free Float		22,81%	16,76%	-7,43%	-12,85%	-11,19%	-23,21%
Threadneedle (Lux) - STANLIB Global Emerging Markets Property Securities								
IU	S&P Emerging Market Property Index		43,35%	34,54%	1,05%	-6,73%	-6,19%	-6,48%
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha								
AEH	US 3 Month Libor		1,26%	1,55%	0,75%	-4,62%	0,32%	1,99%
AFH	US 3 Month Libor		1,26%	1,07%	0,75%	-5,04%	0,32%	1,23%
AGH	US 3 Month Libor		1,26%	2,42%	0,75%	-3,66%	0,32%	2,26%
AU	US 3 Month Libor		1,26%	3,64%	0,75%	-3,23%	0,32%	2,10%
DEH	US 3 Month Libor		1,26%	1,10%	0,75%	-4,99%	0,32%	1,44%
DU	US 3 Month Libor		1,26%	3,17%	0,75%	-3,72%	0,32%	1,97%
IEH	US 3 Month Libor		1,26%	2,49%	0,75%	-3,72%	0,32%	2,41%
IGH	US 3 Month Libor		1,26%	2,91%	0,75%	-2,82%	0,32%	2,91%
IU	US 3 Month Libor		1,26%	4,46%	0,75%	-2,39%	0,32%	2,13%
XGH	US 3 Month Libor	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. April 2017	0,89%	1,99%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZGH	US 3 Month Libor		1,26%	3,23%	0,75%	-2,95%	0,32%	3,43%

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Entwicklung berücksichtigt alle geltenden Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2017 (sie berücksichtigt jedoch nicht eine Verkaufsgebühr, wie sie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses aufgeführt ist). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Vermögensverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Erlöse werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

Performance der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name des Vergleichsindex	Kommentare	31. Dezember 2017		31. Dezember 2016		31. Dezember 2015	
			Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia								
AEC	Citigroup US 3M Treasury Bill	Wertentwicklung seit Auflegung am 20. Juli 2016	0,84%	3,20%	0,14%	-3,81%	k. A.	k. A.
AEH	Citigroup US 3M Treasury Bill	Wertentwicklung seit Auflegung am 20. Juli 2016	0,84%	3,33%	0,14%	-3,81%	k. A.	k. A.
DEH	Citigroup US 3M Treasury Bill	Wertentwicklung seit Auflegung am 20. Juli 2016	0,84%	2,61%	0,14%	-4,11%	k. A.	k. A.
IEH	Citigroup US 3M Treasury Bill	Wertentwicklung seit Auflegung am 20. Juli 2016	0,84%	4,47%	0,14%	-3,51%	k. A.	k. A.
IGH	Citigroup US 3M Treasury Bill	Wertentwicklung seit Auflegung am 20. Juli 2016	0,84%	4,96%	0,14%	-3,11%	k. A.	k. A.
ISH	Citigroup US 3M Treasury Bill	Wertentwicklung seit Auflegung am 20. Juli 2016	0,84%	5,88%	0,14%	-2,91%	k. A.	k. A.
IU	Citigroup US 3M Treasury Bill	Wertentwicklung seit Auflegung am 20. Juli 2016	0,84%	6,60%	0,14%	-2,81%	k. A.	k. A.
IVH	Citigroup US 3M Treasury Bill	Wertentwicklung seit Auflegung am 20. Juli 2016	0,84%	7,00%	0,14%	-2,61%	k. A.	k. A.
LEH	Citigroup US 3M Treasury Bill	Wertentwicklung seit Auflegung am 9. November 2016	0,84%	4,78%	0,05%	0,50%	k. A.	k. A.
LGH	Citigroup US 3M Treasury Bill	Wertentwicklung seit Auflegung am 9. November 2016	0,84%	5,37%	0,05%	0,60%	k. A.	k. A.
LU	Citigroup US 3M Treasury Bill	Wertentwicklung seit Auflegung am 9. November 2016	0,53%	5,56%	0,05%	0,80%	k. A.	k. A.
ZEH	Citigroup US 3M Treasury Bill	Wertentwicklung seit Auflegung am 20. Juli 2016	0,84%	3,85%	0,14%	-3,61%	k. A.	k. A.
ZFH	Citigroup US 3M Treasury Bill	Wertentwicklung seit Auflegung am 20. Juli 2016	0,84%	3,85%	0,14%	-3,81%	k. A.	k. A.
ZU	Citigroup US 3M Treasury Bill	Wertentwicklung seit Auflegung am 20. Juli 2016	0,84%	6,19%	0,14%	-2,81%	k. A.	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities*								
AE	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
AFH	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
AUH	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
DE	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IE	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IEP	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IGH	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IUH	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
JE	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
JGH	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
JUH	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Entwicklung berücksichtigt alle geltenden Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2017 (sie berücksichtigt jedoch nicht eine Verkaufsgebühr, wie sie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses aufgeführt ist). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Vermögensverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Erlöse werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

*Siehe Erläuterung 1.

Performance der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name des Vergleichsindex	Kommentare	31. Dezember 2017		31. Dezember 2016		31. Dezember 2015	
			Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities*								
<i>(Fortsetzung)</i>								
LE	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
LEP	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
LGH	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
YE	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
YGH	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
YUH	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZE	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZFH	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZGH	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZUH	FTSE EUR 1 Month Eurodeposit	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. März 2018	-0,12%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond								
AEH	CITIGROUP USD Euro Deposit (1m) (USD)		1,07%	-0,94%	0,60%	-2,92%	0,31%	-5,81%
AGH	CITIGROUP USD Euro Deposit (1m) (USD)		1,07%	-0,06%	0,60%	-2,16%	0,31%	-5,19%
AU	CITIGROUP USD Euro Deposit (1m) (USD)		1,07%	1,17%	0,60%	-1,53%	0,31%	-5,44%
DEH	CITIGROUP USD Euro Deposit (1m) (USD)		1,07%	-1,72%	0,60%	-3,73%	0,31%	-6,58%
DU	CITIGROUP USD Euro Deposit (1m) (USD)		1,07%	0,25%	0,60%	-2,37%	0,31%	-6,22%
IEH	CITIGROUP USD Euro Deposit (1m) (USD)		1,07%	-0,39%	0,60%	-2,70%	0,31%	-5,29%
IFH	CITIGROUP USD Euro Deposit (1m) (USD)	Wertentwicklung bis zur Schließung am 31. Mai 2017	0,36%	-0,43%	0,60%	-2,88%	0,31%	-6,10%
IU	CITIGROUP USD Euro Deposit (1m) (USD)		1,07%	1,70%	0,60%	-1,03%	0,31%	-4,88%
ZGH	CITIGROUP USD Euro Deposit (1m) (USD)		1,07%	0,35%	0,60%	-1,63%	0,31%	-4,67%
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha								
AE	EURIBOR 3m	Wertentwicklung seit Auflegung am 21. September 2016	-0,33%	-2,57%	-0,09%	1,20%	k. A.	k. A.
AEP	EURIBOR 3m	Wertentwicklung seit Auflegung am 21. September 2016	-0,33%	-2,58%	-0,09%	1,20%	k. A.	k. A.
AUH	EURIBOR 3m	Wertentwicklung seit Auflegung am 21. September 2016	-0,33%	-1,28%	-0,09%	1,60%	k. A.	k. A.
DE	EURIBOR 3m	Wertentwicklung seit Auflegung am 21. September 2016	-0,33%	-3,07%	-0,09%	1,10%	k. A.	k. A.
IE	EURIBOR 3m	Wertentwicklung seit Auflegung am 21. September 2016	-0,33%	-1,68%	-0,09%	1,40%	k. A.	k. A.

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Entwicklung berücksichtigt alle geltenden Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2017 (sie berücksichtigt jedoch nicht eine Verkaufsgebühr, wie sie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses aufgeführt ist). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Vermögensverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Erlöse werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

*Siehe Erläuterung 1.

Performance der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteil- klasse	Name des Vergleichsindex	Kommentare	31. Dezember 2017		31. Dezember 2016		31. Dezember 2015	
			Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite	Vergleichs- index	Portfolio- Rendite
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha								
<i>(Fortsetzung)</i>								
IGH	EURIBOR 3m	Wertentwicklung seit Auflegung am 21. September 2016	-0,33%	-1,08%	-0,09%	1,60%	k. A.	k. A.
LE	EURIBOR 3m	Wertentwicklung seit Auflegung am 21. September 2016	-0,33%	-1,48%	-0,09%	1,50%	k. A.	k. A.
XGH	EURIBOR 3m	Wertentwicklung seit Auflegung am 21. September 2016	-0,33%	-0,78%	-0,09%	2,30%	k. A.	k. A.
ZE	EURIBOR 3m	Wertentwicklung seit Auflegung am 21. September 2016	-0,33%	-1,87%	-0,09%	1,40%	k. A.	k. A.
ZF	EURIBOR 3m	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. April 2017	-0,22%	3,40%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZGH	EURIBOR 3m	Wertentwicklung seit Auflegung am 21. September 2016	-0,33%	-1,18%	-0,09%	1,60%	k. A.	k. A.
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities								
AEH	Bloomberg Commodity Index		1,70%	-1,91%	11,77%	9,32%	-24,66%	-27,27%
AFH	Bloomberg Commodity Index		1,70%	-2,41%	11,77%	8,73%	-24,66%	-27,91%
AGH	Bloomberg Commodity Index		1,70%	-1,26%	11,77%	9,87%	-24,66%	-26,64%
ASH	Bloomberg Commodity Index		1,70%	-0,38%	11,77%	10,81%	-24,66%	-26,25%
AU	Bloomberg Commodity Index		1,70%	0,19%	11,77%	10,98%	-24,66%	-26,35%
DEH	Bloomberg Commodity Index		1,70%	-2,33%	11,77%	8,72%	-24,66%	-27,67%
DU	Bloomberg Commodity Index		1,70%	-0,24%	11,77%	10,47%	-24,66%	-26,75%
IEH	Bloomberg Commodity Index		1,70%	-1,07%	11,77%	10,19%	-24,66%	-26,67%
IFH	Bloomberg Commodity Index		1,70%	-1,52%	11,77%	9,70%	-24,66%	-27,29%
IGH	Bloomberg Commodity Index		1,70%	-0,41%	11,77%	10,73%	-24,66%	-25,97%
IKH	Bloomberg Commodity Index		1,70%	-1,30%	11,77%	9,74%	-24,66%	-26,76%
IU	Bloomberg Commodity Index		1,70%	1,00%	11,77%	12,07%	-24,66%	-25,77%
XGH	Bloomberg Commodity Index	Wertentwicklung bis zur Schließung am 21. September 2017	-2,52%	-2,88%	11,77%	12,03%	-24,66%	-25,18%
XU	Bloomberg Commodity Index		1,70%	2,11%	11,77%	13,27%	-24,66%	-24,96%
ZEH	Bloomberg Commodity Index		1,70%	-0,84%	11,77%	10,20%	-24,66%	-26,77%
ZFH	Bloomberg Commodity Index		1,70%	-1,37%	11,77%	9,79%	-24,66%	-27,76%
ZGH	Bloomberg Commodity Index		1,70%	-0,24%	11,77%	10,90%	-24,66%	-25,84%
ZU	Bloomberg Commodity Index		1,70%	1,13%	11,77%	12,39%	-24,66%	-25,61%
Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity*								
AU	MSCI ACWI Islamic M Series - Bruttorendite	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. April 2017	14,83%	16,18%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
XU	MSCI ACWI Islamic M Series - Bruttorendite	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. April 2017	14,83%	15,80%	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Entwicklung berücksichtigt alle geltenden Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2017 (sie berücksichtigt jedoch nicht eine Verkaufsgebühr, wie sie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses aufgeführt ist). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Vermögensverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Erlöse werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

*Siehe Erläuterung 1.

Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)

Die Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transaction Regulation, „SFTR“) führt Meldepflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFTs“) und Total Return Swaps ein. Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft ist gemäß der Definition in Artikel 3(11) der SFTR Folgendes:

- ein Pensionsgeschäft/umgekehrtes Pensionsgeschäft;
- ein Wertpapier- oder Warenverleihgeschäft und ein Wertpapier- oder Warenentleihgeschäft;
- ein Kauf-/Rückverkaufgeschäft oder ein Verkauf-/Rückkaufgeschäft; oder
- ein Lombardgeschäft.

Zum 31. März 2018 hielt die SICAV Total Return Swaps („TRS“) als die Art von Instrumenten, die in den Geltungsbereich der SFTR fallen.

Weltweite Daten

Portfolio	Art des Vermögenswerts	Nicht realisierter Gewinn und Verlust in der Portfolio-Basiswährung und als absoluter Wert	% des Nettovermögens
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	TRS	2.572.190	1,16
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	TRS	723.602	2,03
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha*	TRS	271.229	0,60
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	TRS	5.174.137	0,94

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten

Es wurden im Geschäftsjahr zum 31. März 2018 keine Sicherheiten wiederverwendet.

Konzentrationsdaten

Alle in Bezug auf TRS zum 31. März 2018 erhaltenen Sicherheiten sind Barsicherheiten. Die Angabe der zehn größten Emittenten ist daher nicht möglich.

Die folgende Tabelle bietet Details zu den zehn wichtigsten Gegenparteien (auf Basis des Bruttovolumens ausstehender Transaktionen) in Bezug auf TRS, die zum 31. März 2018 vom Portfolio gehalten wurden.

Portfolio	Art des Vermögenswerts	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn und Verlust in der Portfolio-Basiswährung und als absoluter Wert
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	TRS	Bank of America Merrill Lynch	2.572.190
		Deutsche Bank	291.046
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	TRS	Citigroup Global Markets	191.955
		Goldman Sachs	111.314
		JPMorgan	90.210
		Morgan Stanley	34.158
		Barclays	4.919
		Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	TRS
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	TRS	JPMorgan	1.945.237
		Goldman Sachs	1.156.525
		Macquarie	1.029.739
		Credit Suisse	589.808
		Citigroup Global Markets	452.828

Aufbewahrung erhaltener Sicherheiten

Barsicherheiten werden im Geldkonto des jeweiligen Portfolios bei der Citibank Europe plc, Niederlassung Luxemburg, gehalten.

Die folgende Tabelle zeigt die von der SICAV zum 31. März 2018 gehaltenen Termineinlagen:

Portfolio	Art der Sicherheit	Kontrahent	Währung der Sicherheit	Betrag der Sicherheit
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Barmittel	Bank of America Merrill Lynch	USD	2.600.000
		Summe	USD	2.600.000
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	Barmittel	JPMorgan	USD	190.000*
		Goldman Sachs	USD	170.000*
		Deutsche Bank	USD	90.000*
		Summe	USD	450.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha*	Barmittel	Goldman Sachs	EUR	1.220.000
		Summe	EUR	1.220.000

Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Transaktionsdaten insgesamt

Portfolio	Art der Sicherheit	Laufzeit (Sicherheit)	Währung der Sicherheit	Laufzeit (SFT/ TRS)	Land der Niederlassung (Gegenpartei)	Abwicklung und Clearing	Qualität der Sicherheit
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Barmittel	Restlaufzeit	USD	3 Monate bis 1 Jahr	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	Barmittel	Restlaufzeit	USD	3 Monate bis 1 Jahr	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Barmittel	Restlaufzeit	EUR	mehr als 1 Jahr	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Barmittel	Restlaufzeit	USD	weniger als 1 Tag	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel
	Wertpapier - US Treasury Bill	3 Monate bis 1 Jahr 1 Monat bis 3 Monate	USD	weniger als 1 Tag	UK	Bilateral	F1+u (Fitch)

Aufbewahrung gewährter Sicherheiten

An die Gegenparteien gezahlte Barmittel und Sicherheiten werden auf separate Konten bei der Gegenpartei eingezahlt.

Der Betrag der für TRS gewährten Sicherheiten zum 31. März 2018 ist wie folgt:

Portfolio	Art der Sicherheit	Kontrahent	Währung der Sicherheit	Betrag der Sicherheit	% der zum Ende des Geschäftsjahres gehaltenen Sicherheiten
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	Barmittel	Morgan Stanley	USD	110.000	0,31
	Barmittel	Citigroup Global Markets	USD	110.000	0,31
	Barmittel	JPMorgan	USD	100.000*	0,28
	Barmittel	Barclays	USD	60.000	0,17
		Summe	USD	380.000	1,07
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Wertpapier - US Treasury Bill	Credit Suisse	USD	960.000	0,17
		Citigroup Global Markets	USD	946.000	0,17
	Barmittel	JPMorgan	USD	3.640.000*	0,66
		Goldman Sachs	USD	2.420.000	0,44
		Summe	USD	10.056.000	1,82

Rendite/Kosten

Die Rendite und die Kosten von TRS-Transaktionen zum 31. März 2018 werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens des jeweiligen Portfolios unter der Überschrift „Zinsaufwendungen aus Swapgeschäften“, „Realisierter Nettogewinn/-verlust aus Swaps“ und „Änderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Swapgeschäften“ ausgewiesen.

*Diese Sicherheiten beziehen sich möglicherweise auf andere Transaktionen als TRS, die nicht unter die Offenlegung gemäß SFT-Verordnung fallen.

Inhaltsverzeichnis

Eingetragener Sitz

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

Anlageberater

Threadneedle Management Luxembourg S.A.

Unterbevollmächtigte¹:

Unterberater

Columbia Management
Investment Advisers, LLC
100 Federal Street
Boston MA 02110
United States of America

Threadneedle Asset
Management Limited
Cannon Place
78 Cannon Street
London EC4N 6AG
United Kingdom

Threadneedle Investments
Singapore (Pte.) Limited
3 Killiney Road
#07-07 Winsland House 1
Singapur 239519
Singapur

Mondrian Investment Partners Limited
5th Floor
10 Gresham Street
London EC2V 7JD
Großbritannien

STANLIB Asset Management Limited
17 Melrose Boulevard
Melrose Arch 2196
Johannesburg
Südafrika

Verwaltungsgesellschaft

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

Portfolio

Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia
Threadneedle (Lux) - Global Energy Equities²
Threadneedle (Lux) - Global Technology
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities²
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond
Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond
Threadneedle (Lux) - American⁴
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha⁴
Threadneedle (Lux) - American Select⁴
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds³
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt³
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities
Threadneedle (Lux) - European Select
Threadneedle (Lux) - European Social Bond²
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond
Threadneedle (Lux) - Gatehouse Shariah Global Equity^{2, 6}
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond³
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities⁴
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds³
Threadneedle (Lux) - Global Focus
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities²
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income⁴
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond⁴
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond³
Threadneedle (Lux) - Greater China Equities
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha*
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities
Threadneedle (Lux) - UK Equities
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity⁵
Threadneedle (Lux) - Asian Focus⁵
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income⁵
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Threadneedle (Lux) - Mondrian Investment Partners -
Emerging Markets Equity

Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity
Threadneedle (Lux) - STANLIB Global Emerging Markets Property
Securities

¹Unter der Verantwortlichkeit und Aufsicht von Threadneedle Management Luxembourg S.A.

²Siehe Erläuterung 1.

³Threadneedle Asset Management Limited kann vorbehaltlich seiner eigenen Haftung die diskretionäre Anlageverwaltung eines Teils des Portfoliovermögens an Columbia Management Investment Advisers, LLC delegieren.

⁴Columbia Management Investment Advisers, LLC gibt Threadneedle Asset Management Limited Anlageempfehlungen und stellt daher für Threadneedle Asset Management Limited eine auf Analysen gestützte Anlageberatung bereit.

⁵Columbia Management Investment Advisers, LLC gibt Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited Anlageempfehlungen und stellt daher für Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited eine auf Analysen gestützte Anlageberatung bereit.

⁶Die Verwaltungsgesellschaft hat ein Shariah-Aufsichtsgremium ernannt, um die Einhaltung der Shariah-Richtlinien durch das Shariah-Portfolio zu überwachen. Gatehouse Bank plc, 14 Grosvenor Street, London, W1K 4PS, Vereinigtes Königreich, wurde zum Shariah-Berater bestellt.

Inhaltsverzeichnis

(Fortsetzung)

Verwahrstelle, Domizil-, Verwaltungs- und Zahlstelle

Citibank Europe plc, Zweigniederlassung Luxemburg
31 Z.A. Bourmicht
L-8070 Bertrange
Großherzogtum Luxemburg

Register- und Transferstelle

International Financial Data Services (Luxembourg) S.A.
47 Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Vertriebsstelle (an verschiedene Vertriebsgesellschaften delegiert)

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

Vertreter und Zahlstellen

In Österreich

Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG
Graben 21
A-1010 Wien
Österreich

In Frankreich

CACEIS Bank France
1/3 Place Valhubert
F-75206 Paris Cedex 13
Frankreich

In Deutschland

J.P. Morgan AG
Junghofstraße 14
D-60311 Frankfurt am Main
Deutschland

In Hongkong

HSBC Institutional Trust Services (Asia) Limited
17/F Tower 2 & 3 HSBC Centre
1 Sham Mong Road
Kowloon
Hongkong

In der Schweiz

RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette
Zweigniederlassung Zürich
Bleicherweg 7
CH-8027 Zürich
Schweiz

Wirtschaftsprüfer

PricewaterhouseCoopers, *Société coopérative*
2 rue Gerhard Mercator, B.P. 1443
L-1014 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Rechtsberater in Luxemburg

Linklaters LLP
35 Avenue John F. Kennedy, B.P. 1107
L-1011 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Rechtsberater in Deutschland

Baum FSLT Rechtsanwälte
Grosser Burstah 42
D-20457 Hamburg
Deutschland

Näheres hierzu erfahren Sie unter columbiathreadneedle.com

