

UNGEPRÜFTER ZWISCHENBERICHT UND ABSCHLUSS
SOCIÉTÉ D'INVESTISSEMENT À CAPITAL VARIABLE
30. SEPTEMBER 2016

THREADNEEDLE (LUX)

Inhalt

Informationen zur Gesellschaft	4	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	37
Abschluss:		Threadneedle (Lux) - STANLIB Global Emerging Markets Property Securities	38
Konsolidierte Jahresabschlüsse für Threadneedle (Lux)	5	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	39
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	6	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia*	40
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	7	Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	41
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	8	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha*	42
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	9	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	43
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	10	Aufstellungen der Wertpapieranlagen:	
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	11	Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	44
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond*	12	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	48
Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond*	13	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	53
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	14	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	58
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	15	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	61
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	16	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	67
Threadneedle (Lux) - Global Focus	17	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond*	71
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	18	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond*	80
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	19	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	83
Threadneedle (Lux) - American	20	Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	86
Threadneedle (Lux) - American Select	21	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	89
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	22	Threadneedle (Lux) - Global Focus	95
Threadneedle (Lux) - Asian Focus	23	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	96
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	24	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	99
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	26	Threadneedle (Lux) - American	101
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	27	Threadneedle (Lux) - American Select	102
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	28	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	103
Threadneedle (Lux) - European Select	29	Threadneedle (Lux) - Asian Focus	105
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	30	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	106
Threadneedle (Lux) - Greater China Equities	31	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	108
Threadneedle (Lux) - Global Energy Equities	32	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	110
Threadneedle (Lux) - Global Technology	33	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	112
Threadneedle (Lux) - Global Equities - Walter Scott & Partners*	34	Threadneedle (Lux) - European Select	114
Threadneedle (Lux) - Mondrian Investment Partners - Focused Emerging Markets Equity	35	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	115
Threadneedle (Lux) - UK Equities	36		

Inhalt

(Fortsetzung)

Threadneedle (Lux) - Greater China Equities	117
Threadneedle (Lux) - Global Energy Equities	119
Threadneedle (Lux) - Global Technology	121
Threadneedle (Lux) - Mondrian Investment Partners - Focused Emerging Markets Equity	123
Threadneedle (Lux) - UK Equities	125
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	126
Threadneedle (Lux) - STANLIB Global Emerging Markets Property Securities	127
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	129
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia*	130
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	131
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha*	136
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	137
Erläuterungen zum Jahresabschluss	138
Informationen für Anteilinhaber	189
Informationen für Anleger in der Schweiz	190
Verzeichnis	191

*Siehe Erläuterung 1.

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

Claude Kremer
Unabhängiger Direktor
Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

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

Tony Poon
Leiterin der Verwaltung, Nordasien,
Columbia Threadneedle Investments
Hongkong

*Siehe Erläuterung 1.

Konsolidierte Jahresabschlüsse für Threadneedle (Lux)

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2, 18	3.313.814.824
Bankguthaben	2	135.889.071
Termineinlagen	2	113.118.125
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		14.307.340
Forderungen aus Zeichnungen		7.309.262
Erhaltene Vermögensverwaltungsgebühr	2	10.106
Zinsforderungen aus Swapgeschäften	2	204.588
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		11.820.872
Vorauszahlung aus Swaps		131.790
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	896.764
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2, 10	9.583.004
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	2, 11	28.277
Sonstige Vermögenswerte		362.464
Aktiva insgesamt		3.607.476.487
Passiva		
Kontokorrentkredite		(2.529.821)
Zum Marktwert verkaufte Optionen	2, 12	(163.097)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(41.044.245)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(10.054.268)
Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(243.732)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(23.969)
Zahlbare Zinsen und Dividenden, netto		(888)
Eingegangene Vorauszahlung aus Swaps		(158.145)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(4.704.293)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(2.034.903)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Futures	2, 11	(738.613)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(3.107.121)
Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	8	(1.879)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(267.176)
Andere Verbindlichkeiten		(829.290)
Passiva insgesamt		(65.901.440)
Nettovermögen insgesamt		3.541.575.047

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		3.335.813.505
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	26.582.049
Zinsen aus Anleihen, netto	2	16.509.159
Zinsen aus Bankguthaben	2	376.300
Zinsen aus Swaps		291.245
Zinsen aus Futures		83
Provision für Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen	5	25.913
Rückerstattungen der Vermögensverwaltungsgebühr	2	46.729
Andere Erträge		602.198
Erträge insgesamt		44.433.676
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(18.545.387)
Performancegebühren	8	(1.879)
Bankspesen		(82.022)
Dividendenausschüttung Aufwendungen		(131.800)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(1.260.042)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(6.574)
Sonstige Betriebskosten	5	(4.751.794)
Depot- und Unterdepotgebühren	5	(60.143)
Sonstige Gebühren	4	(27.270)
Aufwendungen insgesamt		(24.866.911)
Nettoertrag aus Anlagen		19.566.765
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		106.730.120
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		18.016.541
Realisierter Netto(verlust) aus Optionen		(12.194)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(18.673.914)
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(5.295.032)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		584.572
Realisierter Netto(verlust) aus Steuerrückforderung		35
Realisierter Nettogewinn		101.350.128
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		21.651.432
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		9.703.642
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Optionen		(67.011)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(16.770.014)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Futures		641.770
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Kapitalertragssteuer		597.387
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		15.757.206
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		136.674.099
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		973.026.386
Anteilrücknahmen		(871.319.659)
Dividendenausschüttung	7	(7.401.790)
Kapitalbewegungen insgesamt		94.304.937
Wechselkursdifferenzen	2	(24.038.019)
Änderung der gegenseitigen Anlagen in Portfolios	18	(1.179.475)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		3.541.575.047

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	20.537.349
Bankguthaben	2	1.050.631
Termineinlagen	2	500.036
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		19.846
Erhaltene Vermögensverwaltungsgebühr	2	5.727
Zinsforderungen aus Swapgeschäften	2	3.791
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		201.535
Vorauszahlung aus Swaps		18.718
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	13.018
Sonstige Vermögenswerte		11.449
Aktiva insgesamt		22.362.100
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.036.914)
Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(10.975)
Eingegangene Vorauszahlung aus Swaps		(61.883)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(256.293)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Futures	2, 11	(6.986)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(16.303)
Andere Verbindlichkeiten		(5.145)
Passiva insgesamt		(1.394.499)
Nettovermögen insgesamt		20.967.601

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	115.133,429
Klasse AU	615.425,520
Klasse DEC	45.266,863
Klasse DEH	15.207,072
Klasse DU	68.333,009
Klasse W	12.485,074

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEH	14,39 ¹	14,29 ¹	14,89 ¹
Klasse AU	25,72	25,36	26,10
Klasse DEC	9,27 ¹	9,40 ¹	10,32 ¹
Klasse DEH	11,33 ¹	11,28 ¹	11,77 ¹
Klasse DU	28,18	27,85	28,77
Klasse W	55,19	54,37	55,82

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		21.893.119
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	371.528
Zinsen aus Bankguthaben	2	8.470
Zinsen aus Swaps		63.616
Zinsen aus Futures		16
Rückerstattungen der Vermögensverwaltungsgebühr	2	17.176
Erträge insgesamt		460.806
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(121.784)
Bankspesen		(1.149)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(155.567)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(571)
Sonstige Betriebskosten	5	(37.182)
Sonstige Gebühren	4	(4.425)
Aufwendungen insgesamt		(320.678)
Nettoertrag aus Anlagen		140.128
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		70.334
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		164.448
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(75.767)
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(414.302)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		12.355
Realisierter Netto(verlust)		(242.932)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		667.776
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(231.467)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(27.020)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Futures		16.139
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		425.428
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		322.624
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		6.057.790
Anteilrücknahmen		(7.299.581)
Dividendenausschüttung	7	(6.351)
Kapitalbewegungen insgesamt		(1.248.142)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		20.967.601

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	20.967.601	21.893.119	18.692.249

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	21.293.954
Bankguthaben	2	3.084.889
Forderungen aus Zeichnungen		44.304
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		237.385
Aktiva insgesamt		24.660.532
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(174.195)
Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(2.265)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(261.363)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(59.732)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Futures	2, 11	(8.749)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(9.988)
Andere Verbindlichkeiten		(4.001)
Passiva insgesamt		(520.293)
Nettovermögen insgesamt		24.140.239

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	180,000
Klasse AEH	180,000
Klasse AKH	163,000
Klasse AU	250,000
Klasse AUP	250,000
Klasse DEH	180,000
Klasse DU	100,000
Klasse IEH	180,000
Klasse IGH	1.640.116,713
Klasse IKH	163,000
Klasse IU	250,000
Klasse ZGH	3.179,000
Klasse ZU	250,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEC	10,92 ¹	10,30 ¹	10,38 ¹
Klasse AEH	10,92 ¹	10,30 ¹	10,38 ¹
Klasse AKH	109,23 ²	103,10 ²	104,07 ²
Klasse AU	11,12	10,42	10,41
Klasse AUP	11,12	10,42	10,41
Klasse DEH	10,83 ¹	10,24 ¹	10,35 ¹
Klasse DU ⁴	10,06	—	—
Klasse IEH	11,08 ¹	10,42 ¹	10,43 ¹
Klasse IGH	11,30 ³	10,56 ³	10,48 ³
Klasse IKH	110,77 ²	104,25 ²	104,60 ²
Klasse IU	11,27	10,53	10,46
Klasse ZGH	11,24 ³	10,51 ³	10,46 ³
Klasse ZU	11,22	10,49	10,45

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 den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		19.579.548
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	373.081
Zinsen aus Bankguthaben	2	2.963
Zinsen aus Swaps		637
Erträge insgesamt		376.681
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(54.740)
Bankspesen		(1.074)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(38.123)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(125)
Sonstige Betriebskosten	5	(21.890)
Aufwendungen insgesamt		(115.952)
Nettoertrag aus Anlagen		260.729
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		359.074
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		1.208
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(1.475.339)
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(119.404)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(105.897)
Realisierter Netto(verlust)		(1.340.358)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		523.251
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(18.608)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(323.538)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Futures		4.322
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		185.427
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(894.202)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		5.454.893
Kapitalbewegungen insgesamt		5.454.893
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		24.140.239

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	24.140.239	19.579.548	14.805.387

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	68.074.155
Bankguthaben	2	4.704.772
Forderungen aus Zeichnungen		142.698
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		913.238
Sonstige Vermögenswerte		792
Aktiva insgesamt		73.835.655
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(3.720.799)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(131.782)
Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(9.931)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(19.133)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(506.706)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Futures	2, 11	(40.182)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(53.610)
Andere Verbindlichkeiten		(13.593)
Passiva insgesamt		(4.495.736)
Nettovermögen insgesamt		69.339.919

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	791.370,795
Klasse AEP	436.029,099
Klasse DE	722.748,748
Klasse DEP	240.434,446
Klasse IE	652.254,190
Klasse W	1.580,192

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AE	28,01	27,78	27,86
Klasse AEP	15,54	15,55	15,85
Klasse DE	26,93	26,78	27,01
Klasse DEP	11,96	11,99	12,29
Klasse IE	27,55	27,25	27,20
Klasse W	59,35	58,86	58,98

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		67.019.346
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	968.999
Zinsen aus Bankguthaben	2	1.011
Zinsen aus Swaps		3.611
Erträge insgesamt		973.621
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(328.296)
Bankspesen		(10.257)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(102.014)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(1.026)
Sonstige Betriebskosten	5	(87.682)
Aufwendungen insgesamt		(529.275)
Nettoertrag aus Anlagen		444.346
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		112.919
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		572.532
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		298.355
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(483.416)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		3.780
Realisierter Nettogewinn		504.170
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		343.458
Änderung des nicht realisierten Netto-(verlusts) aus Swaps		(506.706)
Änderung des nicht realisierten Netto-(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(147.925)
Änderung des nicht realisierten Netto-(verlusts) aus Futures		(94.717)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(405.890)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		542.626
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		12.293.689
Anteilrücknahmen		(10.440.873)
Dividendenausschüttung	7	(74.869)
Kapitalbewegungen insgesamt		1.777.947
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		69.339.919

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
EUR	69.339.919	67.019.346	65.221.883

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	40.658.095
Bankguthaben	2	3.386.893
Forderungen aus Zeichnungen		752
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		582.527
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	32.495
Sonstige Vermögenswerte		4
Aktiva insgesamt		44.660.766
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.846.724)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(5.369)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(47.074)
Andere Verbindlichkeiten		(9.962)
Passiva insgesamt		(1.909.129)
Nettovermögen insgesamt		42.751.637

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	488.504,515
Klasse AEH	477.383,520
Klasse ASH	6.005,702
Klasse AU	14.723,260
Klasse AUP	1.013.445,361
Klasse DEC	15.345,250
Klasse DEH	259.603,251
Klasse DU	82.343,170
Klasse IEH	232.166,739
Klasse P	5.789,321
Klasse W	36.284,764
Klasse WEH	17.187,809

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEC	14,77 ¹	14,19 ¹	15,04 ¹
Klasse AEH	20,38 ¹	19,05 ¹	19,15 ¹
Klasse ASH	12,55 ²	11,64 ²	11,55 ²
Klasse AU	19,43	18,04	18,04
Klasse AUP	8,56	8,16	8,61
Klasse DEC	10,84 ¹	10,44 ¹	11,13 ¹
Klasse DEH	15,83 ¹	14,84 ¹	15,00 ¹
Klasse DU	15,32	14,27	14,34
Klasse IEH	27,75 ¹	25,84 ¹	25,78 ¹
Klasse IU	—	—	10,09
Klasse P	9,95	9,47	9,95
Klasse W	26,13	24,21	24,08
Klasse WEH	19,60 ¹	18,28 ¹	18,28 ¹

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 den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		39.046.205
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	1.201.003
Zinsen aus Bankguthaben	2	4.663
Erträge insgesamt		1.205.666
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(289.893)
Bankspesen		(346)
Sonstige Betriebskosten	5	(59.314)
Aufwendungen insgesamt		(349.553)
Nettoertrag aus Anlagen		856.113
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		691.205
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		40.899
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		33.895
Realisierter Nettogewinn		765.999
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		1.483.000
Änderung des nicht realisierten Netto-(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(649.469)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		833.531
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		2.455.643
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		5.128.476
Anteilrücknahmen		(3.411.417)
Dividendenausschüttung	7	(467.270)
Kapitalbewegungen insgesamt		1.249.789
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		42.751.637

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	42.751.637	39.046.205	67.721.722

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	97.275.339
Bankguthaben	2	1.388.599
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.454.059
Forderungen aus Zeichnungen		14.442
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.583.736
Aktiva insgesamt		101.716.175
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.216.139)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(18.059)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus		
Devisenterminkontrakten	2, 9	(6.645)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(111.647)
Andere Verbindlichkeiten		(24.794)
Passiva insgesamt		(1.377.284)
Nettovermögen insgesamt		100.338.891

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	88.047,363
Klasse AEH	7.283,930
Klasse ASH	8.003,829
Klasse AU	94.140,230
Klasse AUP	6.454.710,534
Klasse DEH	37.659,471
Klasse DU	15.624,255
Klasse IEH	57.946,133
Klasse SU	4.066,294
Klasse SUP	177.676,601
Klasse W	42.403,851
Klasse ZU	200,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEC	11,76 ¹	10,99 ¹	11,63 ¹
Klasse AEH	26,56 ¹	24,15 ¹	24,17 ¹
Klasse ASH	11,60 ²	10,46 ²	10,36 ²
Klasse AU	70,58	63,71	63,51
Klasse AUP	13,01	12,07	12,71
Klasse DEH	19,99 ¹	18,22 ¹	18,34 ¹
Klasse DU	50,79	45,98	46,07
Klasse IEH	28,14 ¹	25,60 ¹	25,44 ¹
Klasse SU	28,54	25,77	25,69
Klasse SUP	12,59	11,69	12,32
Klasse W	57,83	52,08	51,67
Klasse ZU	10,94	9,84	9,72

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 den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		109.517.844
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	3.151.811
Zinsen aus Bankguthaben	2	4.928
Erträge insgesamt		3.156.739
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(709.746)
Bankspesen		(542)
Sonstige Betriebskosten	5	(149.894)
Aufwendungen insgesamt		(860.182)
Nettoertrag aus Anlagen		2.296.557
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		41.515
Realisierter Nettogewinn aus		
Devisenterminkontrakten		619.952
Realisierter Nettogewinn aus		
Devisengeschäften		159.968
Realisierter Nettogewinn		821.435
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns		
aus Anlagen		7.224.767
Änderung des nicht realisierten Netto-		
(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(629.040)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		6.595.727
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus		
Geschäftstätigkeit		9.713.719
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		15.016.112
Anteilrücknahmen		(31.501.515)
Dividendenausschüttung	7	(2.407.269)
Kapitalbewegungen insgesamt		(18.892.672)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		100.338.891

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	100.338.891	109.517.844	155.654.701

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

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

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	67.789.100
Bankguthaben	2	3.226.991
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.532.903
Forderungen aus Zeichnungen		3.540.961
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.134.812
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	25.145
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	2, 11	27.531
Aktiva insgesamt		77.277.443
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(4.448.081)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(40.898)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(65.348)
Andere Verbindlichkeiten		(17.475)
Passiva insgesamt		(4.571.802)
Nettovermögen insgesamt		72.705.641

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	846.318,048
Klasse AEH	338.113,475
Klasse ASC	50.230,387
Klasse ASH	67.543,062
Klasse AU	231.045,079
Klasse AUP	3.600.350,120
Klasse DEH	492.508,065
Klasse DU	259.873,532
Klasse IEH	1.130.730,911
Klasse W	42.765,037
Klasse ZEH	15.590,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEC	6,79 ¹	6,57 ¹	6,89 ¹
Klasse AEH	15,18 ¹	14,27 ¹	14,18 ¹
Klasse ASC	8,57 ²	8,23 ²	8,54 ²
Klasse ASH	10,53 ²	9,83 ²	9,64 ²
Klasse AU	16,62	15,52	15,32
Klasse AUP	6,51	6,27	6,54
Klasse DEH	11,93 ¹	11,23 ¹	11,16 ¹
Klasse DU	13,04	12,19	12,05
Klasse IEH	16,80 ¹	15,75 ¹	15,52 ¹
Klasse W	19,37	18,08	17,79
Klasse ZEH	10,78 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.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		66.713.179
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	2.116.879
Zinsen aus Bankguthaben	2	8.985
Zinsen aus Swaps		3.755
Andere Erträge		21.457
Erträge insgesamt		2.151.076
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(403.498)
Bankspesen		(1.550)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(10.489)
Sonstige Betriebskosten	5	(89.952)
Aufwendungen insgesamt		(505.489)
Nettoertrag aus Anlagen		1.645.587
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(740.840)
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(97.045)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		185.433
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(41.685)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(58.943)
Realisierter Netto(verlust)		(753.080)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		3.831.523
Änderung des nicht realisierten Netto-(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(882.460)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Futures		11.890
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		2.960.953
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		3.853.460
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		12.980.266
Anteilrücknahmen		(9.969.659)
Dividendenausschüttung	7	(871.605)
Kapitalbewegungen insgesamt		2.139.002
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		72.705.641

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	72.705.641	66.713.179	82.413.476

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond*

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	206.754.422
Bankguthaben	2	7.973.099
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.767.640
Forderungen aus Zeichnungen		114.474
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		3.224.142
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	82.458
Sonstige Vermögenswerte		1.846
Aktiva insgesamt		219.918.081
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(2.993.155)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(2.480.739)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(125.174)
Andere Verbindlichkeiten		(40.301)
Passiva insgesamt		(5.639.369)
Nettovermögen insgesamt		214.278.712

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	116.120,680
Klasse AEH	27.979,442
Klasse ASH	40.023,588
Klasse AU	629.790,782
Klasse AUP	834.798,208
Klasse DEC	75.361,553
Klasse DEH	48.439,063
Klasse DU	107.285,985
Klasse IEH	2.288.142,932
Klasse ZGH	100,000
Klasse ZU	9.353.132,579

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEC	14,31 ¹	13,83 ¹	14,70 ¹
Klasse AEH	29,55 ¹	27,82 ¹	28,09 ¹
Klasse ASH	12,85 ²	12,00 ²	11,98 ²
Klasse AU	31,25	29,21	29,34
Klasse AUP	13,81	13,26	14,03
Klasse DEC	11,02 ¹	10,70 ¹	11,50 ¹
Klasse DEH	21,71 ¹	20,53 ¹	20,94 ¹
Klasse DU	22,93	21,53	21,85
Klasse IEH	28,19 ¹	26,42 ¹	26,51 ¹
Klasse ZGH ⁴	10,32 ³	—	—
Klasse ZU	10,99	10,24	10,22

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.⁴Siehe Erläuterung 1.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		150.840.260
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	5.231.892
Zinsen aus Bankguthaben	2	14.571
Erträge insgesamt		5.246.463
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(692.482)
Bankspesen		(361)
Sonstige Betriebskosten	5	(233.794)
Aufwendungen insgesamt		(926.637)
Nettoertrag aus Anlagen		4.319.826
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		469.146
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		31.771
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(34.894)
Realisierter Nettogewinn		466.023
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		8.098.350
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(707.528)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		7.390.822
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		12.176.671
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		76.078.730
Anteilrücknahmen		(24.435.060)
Dividendenausschüttung	7	(381.889)
Kapitalbewegungen insgesamt		51.261.781
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		214.278.712

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	214.278.712	150.840.260	21.522.034

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond*

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	4.747.555
Bankguthaben	2	320.591
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		36.811
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	65
Nicht realisierter Nettogewinn aus Futures	2, 11	746
Aktiva insgesamt		5.105.768
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(90.677)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(2.821)
Andere Verbindlichkeiten		(654)
Passiva insgesamt		(94.152)
Nettovermögen insgesamt		5.011.616

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	455,300
Klasse AU	99.400,000
Klasse DEH	455,300
Klasse DU	99.400,000
Klasse IEC	455,300
Klasse IEH	455,300
Klasse IFH	493,300
Klasse IU	99.400,000
Klasse IUP	99.400,000
Klasse ZEH	455,300
Klasse ZU	99.400,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

30. September 2016

Klasse AEH [#]	9,99 ¹
Klasse AU [#]	10,02
Klasse DEH [#]	9,99 ¹
Klasse DU [#]	10,01
Klasse IEC [#]	10,00 ¹
Klasse IEH [#]	10,00 ¹
Klasse IFH [#]	10,00 ²
Klasse IU [#]	10,03
Klasse IUP [#]	10,03
Klasse ZEH [#]	10,00 ¹
Klasse ZU [#]	10,02

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 4. August 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		–
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	21.917
Zinsen aus Bankguthaben	2	433
Erträge insgesamt		22.350
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(5.365)
Bankspesen		(30)
Sonstige Betriebskosten	5	(1.244)
Aufwendungen insgesamt		(6.639)
Nettoertrag aus Anlagen		15.711
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		1.474
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		109
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(7.666)
Realisierter Netto(verlust)		(6.083)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		752
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		65
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Futures		746
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		1.563
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		11.191
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		5.000.425
Kapitalbewegungen insgesamt		5.000.425
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		5.011.616

GESAMTNETTOINVENTARWERT

30. September 2016

USD 5.011.616

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	39.502.712
Bankguthaben	2	23.494
Termineinlagen	2	5.501.109
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.052.860
Forderungen aus Zeichnungen		40.955
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		403.636
Aktiva insgesamt		46.524.766
Passiva		
Kontokorrentkredite		(190.097)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(3.185.005)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(22.542)
Nicht realisierter Nettoverlust aus		
Devisenterminkontrakten	2, 9	(416.840)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Futures	2, 11	(4.266)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(28.420)
Andere Verbindlichkeiten		(7.035)
Passiva insgesamt		(3.854.205)
Nettovermögen insgesamt		42.670.561

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	6.877,232
Klasse ASC	250,000
Klasse ASH	560.132,924
Klasse AU	741.992,484
Klasse AUP	250,000
Klasse DEH	250,000
Klasse IEH	250,000
Klasse IGH	1.734.974,014
Klasse ISH	250,000
Klasse IU	278.844,831
Klasse ZU	1.200,570

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEH	11,26 ¹	10,72 ¹	10,67 ¹
Klasse ASC	11,24 ²	10,63 ²	10,46 ²
Klasse ASH	11,50 ²	10,87 ²	10,70 ²
Klasse AU	11,42	10,80	10,68
Klasse AUP	11,18	10,57	10,46
Klasse DEH	11,12 ¹	10,62 ¹	10,62 ¹
Klasse IEH	11,40 ¹	10,83 ¹	10,73 ¹
Klasse IGH	11,59 ³	10,95 ³	10,76 ³
Klasse ISH	11,67 ²	11,00 ²	10,76 ²
Klasse IU	11,58	10,91	10,74
Klasse ZU	11,60	10,93	10,75

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.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		21.789.521
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	508.619
Zinsen aus Bankguthaben	2	3.695
Erträge insgesamt		512.314
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(106.071)
Bankspesen		(1.374)
Sonstige Betriebskosten	5	(26.383)
Sonstige Gebühren	4	(11.643)
Aufwendungen insgesamt		(145.471)
Nettoertrag aus Anlagen		366.843
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		533.378
Realisierter Netto(verlust) aus		
Devisenterminkontrakten		(1.498.399)
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(5.751)
Realisierter Netto(verlust) aus		
Devisengeschäften		(27.228)
Realisierter Netto(verlust)		(998.000)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns		
aus Anlagen		288.338
Änderung des nicht realisierten Netto-		
(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(709.083)
Änderung des nicht realisierten Netto-		
(verlusts) aus Futures		(4.313)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(425.058)
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus		
Geschäftstätigkeit		(1.056.215)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		22.737.684
Anteilrücknahmen		(800.429)
Kapitalbewegungen insgesamt		21.937.255
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		42.670.561

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	42.670.561	21.789.521	19.589.965

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	75.279.061
Bankguthaben	2	7.637.456
Termineinlagen	2	1.202.211
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		219.012
Forderungen aus Zeichnungen		16.709
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		317.753
Nicht realisierter Nettogewinn aus		
Devisenterminkontrakten	2, 9	173.425
Sonstige Vermögenswerte		10.162
Aktiva insgesamt		84.855.789
Passiva		
Kontokorrentkredite		(11)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(347.395)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(38.841)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Futures	2, 11	(358.076)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(102.821)
Andere Verbindlichkeiten		(23.338)
Passiva insgesamt		(870.482)
Nettovermögen insgesamt		83.985.307

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	109.276,775
Klasse AEH	590.802,487
Klasse AU	800.422,907
Klasse AUP	927.330,531
Klasse DEH	242.260,661
Klasse DU	521.524,751
Klasse IGH	26.631,567
Klasse IU	215.311,969
Klasse W	42.875,490

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEC	13,15 ¹	13,07 ¹	13,78 ¹
Klasse AEH	25,17 ¹	24,78 ¹	25,72 ¹
Klasse AU	34,07	33,29	34,37
Klasse AUP	13,73	13,54	14,21
Klasse DEH	18,78 ¹	18,57 ¹	19,41 ¹
Klasse DU	23,07	22,63	23,55
Klasse IGH	24,01 ²	23,45 ²	24,00 ²
Klasse IU	24,46	23,81	24,37
Klasse W	56,32	55,02	56,75

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		84.487.072
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	346.722
Zinsen aus Anleihen, netto	2	462.208
Zinsen aus Bankguthaben	2	10.566
Andere Erträge		5.941
Erträge insgesamt		825.437
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(651.871)
Bankspesen		(1.527)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(1.247)
Sonstige Betriebskosten	5	(143.264)
Aufwendungen insgesamt		(797.909)
Nettoertrag aus Anlagen		27.528
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		690.520
Realisierter Nettogewinn aus		
Devisenterminkontrakten		44.399
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(1.097.549)
Realisierter Netto(verlust) aus		
Devisengeschäften		(23.375)
Realisierter Netto(verlust) aus Steuerrückforderung		2
Realisierter Netto(verlust)		(386.003)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		1.200.857
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		426.204
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Futures		51.961
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		1.679.022
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		1.320.547
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		6.345.427
Anteilrücknahmen		(8.026.439)
Dividendenausschüttung	7	(141.300)
Kapitalbewegungen insgesamt		(1.822.312)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		83.985.307

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	83.985.307	84.487.072	91.776.819

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	57.510.609
Bankguthaben	2	2.817.172
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		281.931
Forderungen aus Zeichnungen		911.157
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		488.162
Sonstige Vermögenswerte		7.420
Aktiva insgesamt		62.016.451
Passiva		
Kontokorrentkredite		(29.692)
Zum Marktwert verkaufte Optionen	2, 12	(163.097)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(823.419)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(63.328)
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(21.871)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(77.831)
Andere Verbindlichkeiten		(15.519)
Passiva insgesamt		(1.194.757)
Nettovermögen insgesamt		60.821.694

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	1.830.758,964
Klasse AEH	170.840,793
Klasse AEP	49.279,089
Klasse AU	276.038,170
Klasse AUP	247.514,913
Klasse DEC	1.989.671,987
Klasse DEP	68.290,737
Klasse DU	140.769,804
Klasse DUP	756.178,943

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEC	9,52 ¹	9,55 ¹	10,16 ¹
Klasse AEH	16,28 ¹	15,79 ¹	15,76 ¹
Klasse AEP	10,19 ¹	9,96 ¹	—
Klasse AGH	—	—	15,97 ²
Klasse AU	16,64	16,01	15,89
Klasse AUP	10,07	9,98	—
Klasse DEC	9,38 ¹	9,45 ¹	10,13 ¹
Klasse DEP	9,96 ¹	9,78 ¹	—
Klasse DU	10,66	10,29	10,30
Klasse DUP	9,53	9,51	10,15
Klasse ZEC ³	—	9,50 ¹	10,06 ¹
Klasse ZGH	—	—	16,13 ²

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		43.338.714
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	524.047
Zinsen aus Anleihen, netto	2	660.142
Zinsen aus Bankguthaben	2	2.771
Erträge insgesamt		1.186.960
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(438.969)
Bankspesen		(1.148)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(1.134)
Sonstige Betriebskosten	5	(80.932)
Aufwendungen insgesamt		(522.183)
Nettoertrag aus Anlagen		664.777
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(4.992)
Realisierter Netto(verlust) aus Optionen		(12.194)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		245.710
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		261.132
Realisierter Netto(verlust) aus Steuerrückforderung		1
Realisierter Nettogewinn		489.657
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		557.896
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Optionen		(67.011)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(334.014)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		156.871
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		1.311.305
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		29.607.427
Anteilrücknahmen		(11.848.051)
Dividendenausschüttung	7	(1.587.701)
Kapitalbewegungen insgesamt		16.171.675
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		60.821.694

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	60.821.694	43.338.714	12.634.399

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	140.424.582
Bankguthaben	2	2.112.003
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		224.954
Forderungen aus Zeichnungen		206.443
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		49.513
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	20.984
Sonstige Vermögenswerte		7.970
Aktiva insgesamt		143.046.449
Passiva		
Kontokorrentkredite		(60.182)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(464.742)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(1.707)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(119.596)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(98.649)
Andere Verbindlichkeiten		(40.148)
Passiva insgesamt		(785.024)
Nettovermögen insgesamt		142.261.425

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	556.744,350
Klasse AEP	3.147,000
Klasse AU	544.381,004
Klasse DEH	23.287,411
Klasse DU	151.667,013
Klasse W	23.014,468
Klasse XU	100,000
Klasse ZE	450.100,000
Klasse ZEP	3.072.000,000
Klasse ZG	282.796,463
Klasse ZU	4.072.856,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEH	31,37 ¹	29,87 ¹	29,84 ¹
Klasse AEP [#]	10,23 ¹	—	—
Klasse AU	47,45	44,84	44,74
Klasse DEH	23,41 ¹	22,38 ¹	22,52 ¹
Klasse DU	25,51	24,19	24,32
Klasse W	72,28	68,26	68,04
Klasse XU [#]	10,45	—	—
Klasse ZE [#]	10,27 ¹	—	—
Klasse ZEP [#]	10,25 ¹	—	—
Klasse ZG [#]	10,38 ²	—	—
Klasse ZU	11,35	10,68	10,59

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 den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		57.932.423
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	537.808
Zinsen aus Bankguthaben	2	2.489
Andere Erträge		432
Erträge insgesamt		540.729
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(487.099)
Bankspesen		(249)
Sonstige Betriebskosten	5	(146.571)
Sonstige Gebühren	4	(115)
Aufwendungen insgesamt		(634.034)
Netto(verlust) aus Anlagen		(93.305)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		887.978
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		96.511
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(78.739)
Realisierter Nettogewinn		905.750
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		3.611.315
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(480.186)
Nettoveränderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Kapitalertragssteuer		(98.649)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		3.032.480
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		3.844.925
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		86.637.390
Anteilrücknahmen		(6.111.423)
Dividendenausschüttung	7	(41.890)
Kapitalbewegungen insgesamt		80.484.077
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		142.261.425

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	142.261.425	57.932.423	39.527.474

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	4.116.792
Bankguthaben	2	447.019
Forderungen aus Zeichnungen		5.619
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		3.078
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	481
Sonstige Vermögenswerte		167
Aktiva insgesamt		4.573.156
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(66.569)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(8.149)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(3.326)
Andere Verbindlichkeiten		(1.255)
Passiva insgesamt		(79.299)
Nettovermögen insgesamt		4.493.857

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	8.455,578
Klasse AU	12.897,538
Klasse DEH	16.778,081
Klasse DU	102.412,032
Klasse IEH	15.002,511
Klasse W	591,752
Klasse ZU	200,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEH	28,08 ¹	26,61 ¹	30,24 ¹
Klasse AU	40,53	38,08	43,27
Klasse DEH	20,74 ¹	19,76 ¹	22,69 ¹
Klasse DU	29,43	27,79	31,90
Klasse IEH	16,29 ¹	15,37 ¹	17,36 ¹
Klasse W	38,24	35,95	40,92
Klasse ZU	8,95	8,38	9,44

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		4.287.665
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	65.683
Zinsen aus Bankguthaben	2	665
Andere Erträge		4.699
Erträge insgesamt		71.047
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(48.103)
Bankspesen		(17)
Sonstige Betriebskosten	5	(7.407)
Aufwendungen insgesamt		(55.527)
Nettoertrag aus Anlagen		15.520
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(19.333)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(199)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(3.259)
Realisierter Netto(verlust)		(22.791)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		244.155
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(12.889)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Kapitalertragssteuer		1.373
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		232.639
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		225.368
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		858.130
Anteilrücknahmen		(877.306)
Kapitalbewegungen insgesamt		(19.176)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		4.493.857

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	4.493.857	4.287.665	6.697.482

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	8.839.555
Bankguthaben	2	101.909
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		110.619
Forderungen aus Zeichnungen		853
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		7.781
Sonstige Vermögenswerte		1.712
Aktiva insgesamt		9.062.429
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(60.444)
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(91.099)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(7.198)
Andere Verbindlichkeiten		(1.678)
Passiva insgesamt		(160.419)
Nettovermögen insgesamt		8.902.010

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	89.162,647
Klasse AGH	183.673,107
Klasse DE	32.460,258
Klasse IE	21.436,388
Klasse IGH	42.013,396
Klasse ZGH	2.146,141

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AE	20,97	20,17	21,83
Klasse AGH	20,97 ¹	20,17 ¹	21,93 ¹
Klasse DE	16,37	15,78	17,16
Klasse IE	29,21	27,97	30,01
Klasse IGH	28,24 ¹	27,02 ¹	29,13 ¹
Klasse ZGH	20,59 ¹	19,72 ¹	21,25 ¹

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		5.225.081
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	37.514
Zinsen aus Bankguthaben	2	92
Erträge insgesamt		37.606
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(30.933)
Bankspesen		(44)
Sonstige Betriebskosten	5	(7.409)
Aufwendungen insgesamt		(38.386)
Netto(verlust) aus Anlagen		(780)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		221.373
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(116.438)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		8.365
Realisierter Netto(verlust) aus Steuerrückforderung		1
Realisierter Nettogewinn		113.301
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(30.356)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(71.311)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(101.667)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		10.854
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		4.855.561
Anteilrücknahmen		(1.189.486)
Kapitalbewegungen insgesamt		3.666.075
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		8.902.010

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
EUR	8.902.010	5.225.081	5.244.826

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	189.312.432
Bankguthaben	2	305.005
Forderungen aus Zeichnungen		122.350
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		168.012
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	34.248
Sonstige Vermögenswerte		79
Aktiva insgesamt		189.942.126
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(130.399)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(136.907)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(182.583)
Andere Verbindlichkeiten		(42.643)
Passiva insgesamt		(492.532)
Nettovermögen insgesamt		189.449.594

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	68.137,271
Klasse AU	1.125.760,049
Klasse DEH	103.076,417
Klasse DU	1.282.438,150
Klasse IEH	671.881,885
Klasse IU	1.982.850,159
Klasse W	6.237,291

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEH	34,27 ¹	33,06 ¹	33,89 ¹
Klasse AU	53,41	51,12	52,46
Klasse DEH	25,82 ¹	24,97 ¹	25,76 ¹
Klasse DU	21,15	20,29	20,93
Klasse IEH	35,49 ¹	34,09 ¹	34,72 ¹
Klasse IU	34,98	33,33	33,93
Klasse W	70,06	66,93	68,45

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		196.693.655
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.326.315
Zinsen aus Bankguthaben	2	3.544
Erträge insgesamt		1.329.859
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(1.157.124)
Bankspesen		(322)
Sonstige Betriebskosten	5	(276.673)
Aufwendungen insgesamt		(1.434.119)
Netto(verlust) aus Anlagen		(104.260)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		1.985.793
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		164.760
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(7.120)
Realisierter Nettogewinn		2.143.433
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		6.886.591
Änderung des nicht realisierten Netto-(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(849.665)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		6.036.926
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		8.076.099
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		14.912.072
Anteilrücknahmen		(30.232.232)
Kapitalbewegungen insgesamt		(15.320.160)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		189.449.594

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	189.449.594	196.693.655	166.739.890

Threadneedle (Lux) - American Select

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	5.235.775
Bankguthaben	2	92.608
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		28.604
Forderungen aus Zeichnungen		764
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		3.961
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	980
Aktiva insgesamt		5.362.692
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(7.368)
Andere Verbindlichkeiten		(1.569)
Passiva insgesamt		(8.937)
Nettovermögen insgesamt		5.353.755

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	9.281,020
Klasse AU	173.196,309
Klasse DEH	8.293,639
Klasse DU	58.217,896
Klasse IEH	3.701,160
Klasse W	40.761,969

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEH	22,00 ¹	20,84 ¹	21,38 ¹
Klasse AU	18,14	17,05	17,49
Klasse DEH	15,57 ¹	14,80 ¹	15,31 ¹
Klasse DU	16,54	15,60	16,13
Klasse IEH	22,53 ¹	21,26 ¹	21,66 ¹
Klasse W	19,13	17,97	18,42
Klasse ZFH ²	—	15,47 ²	15,88 ²

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 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		6.035.001
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	34.337
Zinsen aus Bankguthaben	2	198
Erträge insgesamt		34.535
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(46.912)
Bankspesen		(3)
Sonstige Betriebskosten	5	(10.005)
Aufwendungen insgesamt		(56.920)
Netto(verlust) aus Anlagen		(22.385)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		228.673
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		7.921
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(4.165)
Realisierter Nettogewinn		232.429
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		150.993
Änderung des nicht realisierten Netto-(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(22.397)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		128.596
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		338.640
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		278.920
Anteilrücknahmen		(1.298.806)
Kapitalbewegungen insgesamt		(1.019.886)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		5.353.755

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	5.353.755	6.035.001	10.978.099

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	7.078.825
Bankguthaben	2	196.426
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		65.765
Forderungen aus Zeichnungen		12.757
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		19.687
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	113
Sonstige Vermögenswerte		178
Aktiva insgesamt		7.373.751
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(29.437)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(4.955)
Andere Verbindlichkeiten		(1.599)
Passiva insgesamt		(35.991)
Nettovermögen insgesamt		7.337.760

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	100,000
Klasse AF	100,000
Klasse ASH	5.010,566
Klasse AU	3.842,036
Klasse DE	100,000
Klasse IE	100,000
Klasse IF	100,000
Klasse ISH	630,000
Klasse IU	497.000,000
Klasse ZE	100,000
Klasse ZEH	360,000
Klasse ZF	100,000
Klasse ZU	120.068,931

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AE	11,75 ¹	10,20 ¹	—
Klasse AF	11,80 ²	10,27 ²	—
Klasse ASH	11,54 ³	10,17 ³	10,86 ³
Klasse AU	11,51	10,14	10,85
Klasse DE	11,62 ¹	10,15 ¹	—
Klasse IE	11,83 ¹	10,24 ¹	—
Klasse IF	11,89 ²	10,31 ²	—
Klasse ISH	11,74 ³	10,31 ³	10,94 ³
Klasse IU	11,72	10,28	10,92
Klasse ZE	11,84 ¹	10,25 ¹	—
Klasse ZEH	11,60 ¹	10,27 ¹	10,91 ¹
Klasse ZF	11,89 ²	10,31 ²	—
Klasse ZU	11,72	10,28	10,92

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.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		6.423.002
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	148.022
Zinsen aus Bankguthaben	2	604
Erträge insgesamt		148.626
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(28.003)
Bankspesen		(3)
Sonstige Betriebskosten	5	(9.041)
Aufwendungen insgesamt		(37.047)
Nettoertrag aus Anlagen		111.579
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		453.366
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		686
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(8.119)
Realisierter Nettogewinn		445.933
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		336.851
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(714)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		336.137
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		893.649
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		221.956
Anteilrücknahmen		(200.847)
Kapitalbewegungen insgesamt		21.109
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		7.337.760

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	7.337.760	6.423.002	6.149.539

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asian Focus

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	6.293.763
Bankguthaben	2	334.454
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		33.805
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		11.317
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	640
Aktiva insgesamt		6.673.979
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(23.180)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(4.904)
Andere Verbindlichkeiten		(1.436)
Passiva insgesamt		(29.520)
Nettovermögen insgesamt		6.644.459

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	100,000
Klasse AF	100,000
Klasse ASH	31.783,147
Klasse AU	33.877,140
Klasse DE	100,000
Klasse DEH	360,000
Klasse IE	100,000
Klasse IF	100,000
Klasse ISH	630,000
Klasse IU	496.500,000
Klasse ZE	100,000
Klasse ZEH	360,000
Klasse ZF	100,000
Klasse ZU	21.065,022

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AE	11,59 ¹	10,20 ¹	—
Klasse AF	11,56 ²	10,18 ²	—
Klasse ASH	11,37 ³	10,16 ³	11,26 ³
Klasse AU	11,33	10,11	11,25
Klasse DE	11,47 ¹	10,15 ¹	—
Klasse DEH	10,96 ¹	9,92 ¹	11,13 ¹
Klasse IE	11,67 ¹	10,23 ¹	—
Klasse IF	11,63 ²	10,22 ²	—
Klasse ISH	11,58 ³	10,31 ³	11,33 ³
Klasse IU	11,54	10,26	11,32
Klasse ZE	11,68 ¹	10,24 ¹	—
Klasse ZEH	11,44 ¹	10,25 ¹	11,30 ¹
Klasse ZF	11,64 ²	10,22 ²	—
Klasse ZU	11,53	10,25	11,32

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.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		5.901.015
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	109.172
Zinsen aus Bankguthaben	2	659
Erträge insgesamt		109.831
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(27.789)
Bankspesen		(9)
Sonstige Betriebskosten	5	(8.041)
Aufwendungen insgesamt		(35.839)
Nettoertrag aus Anlagen		73.992
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		223.111
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		2.322
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(10.107)
Realisierter Nettogewinn		215.326
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		448.772
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(5.420)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		443.352
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		732.670
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		15.406
Anteilrücknahmen		(4.632)
Kapitalbewegungen insgesamt		10.774
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		6.644.459

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	6.644.459	5.901.015	6.492.624

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	31.212.192
Bankguthaben	2	916.374
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		540.953
Forderungen aus Zeichnungen		107.972
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		85.960
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	107.291
Sonstige Vermögenswerte		576
Aktiva insgesamt		32.971.318
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(473.272)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(802)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(36.751)
Andere Verbindlichkeiten		(8.886)
Passiva insgesamt		(519.711)
Nettovermögen insgesamt		32.451.607

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	100,000
Klasse AEP	100,000
Klasse AF	100,000
Klasse AFP	100,000
Klasse ASC	2.210.172,598
Klasse ASH	157.383,601
Klasse AU	411.513,730
Klasse AUP	161.539,991
Klasse AVC	135.344,875
Klasse AVH	224.497,371
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	419.322,165
Klasse IUP	100,000
Klasse ZE	100,000
Klasse ZEH	360,000
Klasse ZEP	100,000
Klasse ZF	100,000
Klasse ZFP	100,000
Klasse ZU	66.886,157
Klasse ZUP	100,000

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		33.956.561
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	776.295
Zinsen aus Bankguthaben	2	3.004
Erträge insgesamt		779.299
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(228.098)
Bankspesen		(621)
Sonstige Betriebskosten	5	(55.166)
Aufwendungen insgesamt		(283.885)
Nettoertrag aus Anlagen		495.414
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		1.847.044
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		185.845
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(38.274)
Realisierter Nettogewinn		1.994.615
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		766.000
Änderung des nicht realisierten Netto-(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(423.812)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		342.188
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		2.832.217
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		4.542.527
Anteilrücknahmen		(8.514.764)
Dividendenausschüttung	7	(364.934)
Kapitalbewegungen insgesamt		(4.337.171)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		32.451.607

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	32.451.607	33.956.561	57.589.333

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AE	11,37 ¹	10,23 ¹	—
Klasse AEP	11,37 ¹	10,23 ¹	—
Klasse AF	11,34 ²	10,22 ²	—
Klasse AFP	11,34 ²	10,22 ²	—
Klasse ASC	10,19 ³	9,49 ³	10,56 ³
Klasse ASH	11,08 ³	10,13 ³	10,86 ³
Klasse AU	11,17	10,18	10,95
Klasse AUP	10,33	9,60	10,70
Klasse AVC	10,01 ⁴	9,31 ⁴	10,32 ⁴
Klasse AVH	10,49 ⁴	9,57 ⁴	10,21 ⁴
Klasse DE	11,25 ¹	10,17 ¹	—
Klasse IE	11,45 ¹	10,26 ¹	—
Klasse IEP	11,45 ¹	10,26 ¹	—
Klasse IF	11,42 ²	10,26 ²	—
Klasse IFP	11,42 ²	10,26 ²	—
Klasse ISH	11,29 ³	10,28 ³	10,94 ³
Klasse IU	11,37	10,33	11,02
Klasse IUP	11,55	10,55	—
Klasse ZE	11,46 ¹	10,27 ¹	—
Klasse ZEH	11,15 ¹	10,23 ¹	10,91 ¹
Klasse ZEP	11,46 ¹	10,27 ¹	—
Klasse ZF	11,43 ²	10,26 ²	—
Klasse ZFP	11,43 ²	10,26 ²	—
Klasse ZU	11,37	10,33	11,02
Klasse ZUP	11,55	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.

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	746.375.386
Bankguthaben	2	27.452.501
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.774.391
Forderungen aus Zeichnungen		226.860
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		569.743
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	15.810
Sonstige Vermögenswerte		2.855
Aktiva insgesamt		776.417.546
Passiva		
Kontokorrentkredite		(53.066)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.704.360)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(2.845.604)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(626.516)
Andere Verbindlichkeiten		(191.761)
Passiva insgesamt		(5.421.307)
Nettovermögen insgesamt		770.996.239

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	540,979
Klasse AEH	16.835,317
Klasse ASH	3.000,000
Klasse AU	6.418.485,996
Klasse AUP	479.887,000
Klasse DEH	602,765
Klasse DU	4.130,442
Klasse IFH	2.600,000
Klasse IU	10.672.223,678
Klasse ZEH	1.096.388,000
Klasse ZFH	200,000
Klasse ZGH	200,000
Klasse ZU	13.421.453,002

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEC	11,37 ¹	10,90 ¹	—
Klasse AEH	17,31 ¹	16,57 ¹	16,53 ¹
Klasse ASH	13,11 ²	12,46 ²	12,35 ²
Klasse AU	28,49	27,05	26,96
Klasse AUP	11,34	10,86	—
Klasse DEH	14,82 ¹	14,22 ¹	14,27 ¹
Klasse DU	14,55	13,85	13,87
Klasse IFH	27,02 ³	25,83 ³	25,84 ³
Klasse IU	39,49	37,35	36,92
Klasse ZEH	10,85 ¹	10,35 ¹	10,25 ¹
Klasse ZFH	10,76 ³	10,29 ³	10,28 ³
Klasse ZGH	10,95 ⁴	10,41 ⁴	10,29 ⁴
Klasse ZU	10,98	10,38	10,28

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		700.588.642
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	4.921.454
Zinsen aus Bankguthaben	2	44.511
Erträge insgesamt		4.965.965
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(3.601.667)
Bankspesen		(14)
Sonstige Betriebskosten	5	(1.077.220)
Aufwendungen insgesamt		(4.678.901)
Nettoertrag aus Anlagen		287.064
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		16.042.424
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		86.943
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(46.514)
Realisierter Nettogewinn		16.082.853
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		21.314.350
Änderung des nicht realisierten Netto-(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(105.591)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		21.208.759
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		37.578.676
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		265.706.237
Anteilrücknahmen		(232.825.099)
Dividendenausschüttung	7	(52.217)
Kapitalbewegungen insgesamt		32.828.921
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		770.996.239

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	770.996.239	700.588.642	497.060.405

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	101.107.121
Bankguthaben	2	388.069
Forderungen aus Zeichnungen		62.550
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		16.269
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	13.327
Sonstige Vermögenswerte		103.495
Aktiva insgesamt		101.690.831
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(293.631)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(89.317)
Andere Verbindlichkeiten		(23.260)
Passiva insgesamt		(406.208)
Nettovermögen insgesamt		101.284.623

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	613.505,362
Klasse ASH	1.231.351,699
Klasse AUH	198.248,720
Klasse DE	335.239,484
Klasse IE	447.500,378
Klasse W	94.787,954
Klasse XE	614.798,637
Klasse ZUH	200,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AE	54,49	53,98	61,37
Klasse ASH	14,68 ¹	14,44 ¹	16,46 ¹
Klasse AUH	17,09 ²	16,79 ²	19,33 ²
Klasse DE	20,08	19,96	22,87
Klasse IE	36,97	36,48	41,14
Klasse W	45,67	45,22	51,37
Klasse XE	41,37	40,64	45,42
Klasse ZUH	10,78 ²	10,55 ²	12,05 ²

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		123.307.428
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.013.121
Zinsen aus Bankguthaben	2	79
Erträge insgesamt		2.013.200
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(574.874)
Bankspesen		(3.399)
Sonstige Betriebskosten	5	(157.156)
Aufwendungen insgesamt		(735.429)
Nettoertrag aus Anlagen		1.277.771
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		1.047.544
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		52.260
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		26.305
Realisierter Nettogewinn		1.126.109
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(1.050.129)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		131.886
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(918.243)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		1.485.637
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		6.646.923
Anteilrücknahmen		(30.155.365)
Kapitalbewegungen insgesamt		(23.508.442)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		101.284.623

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
EUR	101.284.623	123.307.428	176.032.528

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	303.148.893
Bankguthaben	2	4.112.853
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		2.124.863
Forderungen aus Zeichnungen		152.400
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		132.469
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	10.898
Sonstige Vermögenswerte		142.302
Aktiva insgesamt		309.824.678
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(4.345.620)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(754.133)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(318.076)
Andere Verbindlichkeiten		(75.079)
Passiva insgesamt		(5.492.908)
Nettovermögen insgesamt		304.331.770

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	3.888.501,484
Klasse ASH	703.485,096
Klasse DE	1.056.653,323
Klasse IE	3.924.995,143
Klasse W	13.085,995

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AE	30,54	29,77	28,67
Klasse ASH	19,60 ¹	18,98 ¹	18,32 ¹
Klasse DE	28,67	28,08	27,29
Klasse IE	37,10	36,03	34,44
Klasse W	51,20	49,93	48,11

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		301.865.609
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	4.285.495
Zinsen aus Bankguthaben	2	83
Erträge insgesamt		4.285.578
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(1.942.846)
Bankspesen		(9.732)
Sonstige Betriebskosten	5	(453.702)
Aufwendungen insgesamt		(2.406.280)
Nettoertrag aus Anlagen		1.879.298
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		3.985.890
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		78.869
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		17.878
Realisierter Netto(verlust) aus Steuerrückforderung		28
Realisierter Nettogewinn		4.082.665
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		2.237.346
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		28.261
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		2.265.607
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		8.227.570
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		61.567.282
Anteilrücknahmen		(67.328.691)
Kapitalbewegungen insgesamt		(5.761.409)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		304.331.770

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
EUR	304.331.770	301.865.609	239.003.228

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Select

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	10.440.174
Bankguthaben	2	186.380
Forderungen aus Zeichnungen		14.905
Sonstige Vermögenswerte		6.765
Aktiva insgesamt		10.648.224
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.612)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(1.200)
Zahlbare Zinsen und Dividenden, netto		(86)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(56.243)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(6.455)
Andere Verbindlichkeiten		(1.964)
Passiva insgesamt		(67.560)
Nettovermögen insgesamt		10.580.664

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	178.739,789
Klasse AGH	1.613,562
Klasse AUH	32.592,928
Klasse IE	125.906,415
Klasse ZGH	137.712,413

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AE	19,28	18,83	20,92
Klasse AGH	19,89 ¹	19,32 ¹	21,46 ¹
Klasse AUH	19,68 ²	19,01 ²	21,20 ²
Klasse IE	26,72	25,98	28,62
Klasse ZGH	19,87 ¹	19,26 ¹	21,34 ¹

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		9.210.792
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	109.060
Zinsen aus Bankguthaben	2	1.833
Erträge insgesamt		110.893
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(38.745)
Bankspesen		(467)
Sonstige Betriebskosten	5	(12.664)
Aufwendungen insgesamt		(51.876)
Nettoertrag aus Anlagen		59.017
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(248.760)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(259.451)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(10.759)
Realisierter Netto(verlust)		(518.970)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		401.645
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		15.174
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		416.819
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(43.134)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		6.039.143
Anteilrücknahmen		(4.626.137)
Kapitalbewegungen insgesamt		1.413.006
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		10.580.664

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
EUR	10.580.664	9.210.792	6.927.633

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	36.900.323
Bankguthaben	2	820.845
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		357.822
Forderungen aus Zeichnungen		9.358
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		94.643
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	325
Aktiva insgesamt		38.183.316
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(47.140)
Andere Verbindlichkeiten		(10.901)
Passiva insgesamt		(58.041)
Nettovermögen insgesamt		38.125.275

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	8.490,316
Klasse AU	503.089,057
Klasse DEH	11.444,315
Klasse DU	23.378,979
Klasse W	40.674,795
Klasse ZGH	1.000,000
Klasse ZUP	2.977,507

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEH	30,72 ¹	28,49 ¹	30,55 ¹
Klasse AU	68,75	63,23	67,97
Klasse DEH	22,66 ¹	21,13 ¹	22,89 ¹
Klasse DU	34,73	32,10	34,86
Klasse W	51,34	47,25	50,87
Klasse ZGH	16,34 ²	15,03 ²	15,98 ²
Klasse ZUP [#]	11,00	—	—

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 den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		35.404.166
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	969.846
Zinsen aus Bankguthaben	2	2.705
Erträge insgesamt		972.551
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(275.907)
Bankspesen		(1.725)
Sonstige Betriebskosten	5	(62.840)
Aufwendungen insgesamt		(340.472)
Nettoertrag aus Anlagen		632.079
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		681.111
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.035
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(23.860)
Realisierter Nettogewinn		658.286
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		1.727.684
Änderung des nicht realisierten Netto-(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(15.179)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Kapitalertragssteuer		11.606
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		1.724.111
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		3.014.476
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		676.169
Anteilrücknahmen		(968.828)
Dividendenausschüttung	7	(708)
Kapitalbewegungen insgesamt		(293.367)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		38.125.275

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	38.125.275	35.404.166	32.946.312

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Greater China Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	4.265.694
Bankguthaben	2	46.855
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		75.804
Forderungen aus Zeichnungen		837
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		9.195
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	624
Aktiva insgesamt		4.399.009
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(6.544)
Andere Verbindlichkeiten		(1.280)
Passiva insgesamt		(7.824)
Nettovermögen insgesamt		4.391.185

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	10.488,266
Klasse AU	52.732,021
Klasse DEH	8.374,103
Klasse DU	29.694,033
Klasse W	2.086,219

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEH	32,99 ¹	29,09 ¹	34,18 ¹
Klasse AU	49,43	43,23	51,17
Klasse DEH	24,31 ¹	21,54 ¹	25,51 ¹
Klasse DU	36,10	31,73	37,94
Klasse W	45,55	39,86	47,26

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		3.890.625
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	88.661
Zinsen aus Bankguthaben	2	15
Erträge insgesamt		88.676
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(35.353)
Sonstige Betriebskosten	5	(6.846)
Aufwendungen insgesamt		(42.199)
Nettoertrag aus Anlagen		46.477
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		33.188
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		3.176
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(179)
Realisierter Nettogewinn		36.185
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		453.875
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(12.747)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		441.128
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		523.790
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		601.127
Anteilrücknahmen		(624.357)
Kapitalbewegungen insgesamt		(23.230)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		4.391.185

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	4.391.185	3.890.625	6.850.511

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Energy Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	27.548.708
Bankguthaben	2	191.380
Forderungen aus Zeichnungen		347.880
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		41.316
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	12.859
Sonstige Vermögenswerte		55
Aktiva insgesamt		28.142.198
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(415.363)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(3.534)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(37.623)
Andere Verbindlichkeiten		(7.609)
Passiva insgesamt		(464.129)
Nettovermögen insgesamt		27.678.069

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	464.184,651
Klasse AU	436.145,589
Klasse DEH	95.892,143
Klasse DU	98.239,442
Klasse W	12.573,359

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEH	20,99 ¹	19,03 ¹	23,66 ¹
Klasse AU	28,67	25,79	32,07
Klasse DEH	15,77 ¹	14,34 ¹	17,92 ¹
Klasse DU	21,35	19,26	24,07
Klasse W	34,08	30,61	37,93

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		25.172.595
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	391.875
Zinsen aus Bankguthaben	2	720
Erträge insgesamt		392.595
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(234.075)
Bankspesen		(118)
Sonstige Betriebskosten	5	(46.197)
Aufwendungen insgesamt		(280.390)
Nettoertrag aus Anlagen		112.205
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(769.277)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		27.141
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		8.695
Realisierter Netto(verlust)		(733.441)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		3.415.100
Änderung des nicht realisierten Netto-(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(291.079)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		3.124.021
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		2.502.785
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		5.231.512
Anteilrücknahmen		(5.228.823)
Kapitalbewegungen insgesamt		2.689
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		27.678.069

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	27.678.069	25.172.595	19.125.470

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	55.678.524
Bankguthaben	2	796.383
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		503.881
Forderungen aus Zeichnungen		47.552
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		9.736
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	264
Aktiva insgesamt		57.036.340
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(788.495)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(61.890)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(81.071)
Andere Verbindlichkeiten		(15.764)
Passiva insgesamt		(947.220)
Nettovermögen insgesamt		56.089.120

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	9.182,060
Klasse AU	1.063.720,816
Klasse BU	153.116,662
Klasse DU	408.917,959
Klasse ZU	2.744,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEH	25,10 ¹	22,94 ¹	21,73 ¹
Klasse AU	29,80	27,02	25,66
Klasse BU	38,42	34,89	33,22
Klasse DU	44,54	40,45	38,51
Klasse ZU	13,05	11,78	11,08

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		27.982.645
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	100.208
Zinsen aus Bankguthaben	2	1.762
Erträge insgesamt		101.970
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(315.550)
Bankspesen		(63)
Sonstige Betriebskosten	5	(58.564)
Aufwendungen insgesamt		(374.177)
Netto(verlust) aus Anlagen		(272.207)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		1.643.010
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.592
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		968
Realisierter Nettogewinn		1.645.570
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		2.356.779
Änderung des nicht realisierten Netto-(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(6.328)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		2.350.451
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		3.723.814
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		28.995.591
Anteilrücknahmen		(4.612.930)
Kapitalbewegungen insgesamt		24.382.661
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		56.089.120

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	56.089.120	27.982.645	37.441.092

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Equities - Walter Scott & Partners*

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 16. August 2016

	Erläuterungen	2016 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		156.894.377
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	971.353
Zinsen aus Bankguthaben	2	6
Erträge insgesamt		971.359
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(430.011)
Bankspesen		(14.733)
Sonstige Betriebskosten	5	(86.002)
Depot- und Unterdepotgebühren	5	(6.875)
Aufwendungen insgesamt		(537.621)
Nettoertrag aus Anlagen		433.738
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		67.376.389
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		354.921
Realisierter Nettogewinn		67.731.310
Änderung des nicht realisierten Netto- (verlusts) aus Anlagen		(62.817.637)
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(62.817.637)
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		5.347.411
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		484.517
Anteilrücknahmen		(162.726.305)
Kapitalbewegungen insgesamt		(162.241.788)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		—

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	16. August 2016	31. März 2016	31. März 2015
EUR	—	156.894.377	162.594.826

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	16. August 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse WS	—	58,40	60,95

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

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

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	220.459.985
Bankguthaben	2	5.228.732
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.733.116
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		187.262
Sonstige Vermögenswerte		4.971
Aktiva insgesamt		227.614.066
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(3.627.972)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(174.748)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(126.045)
Andere Verbindlichkeiten		(48.998)
Passiva insgesamt		(3.977.763)
Nettovermögen insgesamt		223.636.303

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse M	6.587.171,337
----------	---------------

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse M	33,95	31,89	36,23

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		214.832.904
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	4.301.533
Zinsen aus Bankguthaben	2	11.219
Provision für Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen	5	25.913
Andere Erträge		569.669
Erträge insgesamt		4.908.334
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(1.029.032)
Bankspesen		(53)
Sonstige Betriebskosten	5	(216.638)
Depot- und Unterdepotgebühren	5	(52.417)
Sonstige Gebühren	4	(1.620)
Aufwendungen insgesamt		(1.299.760)
Nettoertrag aus Anlagen		3.608.574
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(757.977)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		50.271
Realisierter Netto(verlust)		(707.706)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		9.951.851
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Kapitalertragssteuer		683.116
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		10.634.967
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		13.535.835
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		224.472
Anteilrücknahmen		(4.956.908)
Kapitalbewegungen insgesamt		(4.732.436)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		223.636.303

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	223.636.303	214.832.904	244.767.705

*Siehe Erläuterung 20.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - UK Equities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 GBP
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	131.806.907
Bankguthaben	2	1.812.531
Forderungen aus Zeichnungen		264.671
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		312.871
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	268.141
Sonstige Vermögenswerte		14
Aktiva insgesamt		134.465.135
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(1.285.221)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(97.465)
Andere Verbindlichkeiten		(31.742)
Passiva insgesamt		(1.414.428)
Nettovermögen insgesamt		133.050.707

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	209.138,990
Klasse AG	839.222,723
Klasse AGP	412.259,709
Klasse IEH	251.819,472
Klasse IG	372.600,877
Klasse IGP	1.018.909,894
Klasse ZEH	480.394,702
Klasse ZFH	19.051,241
Klasse ZG	1.453.254,984
Klasse ZGP	603.484,521
Klasse ZUH	381.041,553

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEH	18,88 ¹	17,40 ¹	17,15 ¹
Klasse AG	25,21	23,16	22,81
Klasse AGP	22,10	20,70	21,13
Klasse IEH	27,13 ¹	24,92 ¹	24,37 ¹
Klasse IG	34,96	31,96	31,23
Klasse IGP	30,90	28,73	29,07
Klasse ZEH	11,23 ¹	10,33 ¹	—
Klasse ZFH	11,01 ²	10,16 ²	—
Klasse ZG	23,45	21,45	20,98
Klasse ZGP	11,21	10,34	—
Klasse ZUH	11,14 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.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 GBP
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		98.246.818
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.113.867
Zinsen aus Bankguthaben	2	3.050
Erträge insgesamt		2.116.917
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(520.875)
Bankspesen		(398)
Sonstige Betriebskosten	5	(164.602)
Aufwendungen insgesamt		(685.875)
Nettoertrag aus Anlagen		1.431.042
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		1.009.174
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		898.497
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(14.033)
Realisierter Nettogewinn		1.893.638
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		7.260.873
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		186.443
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		7.447.316
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		10.771.996
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		56.369.409
Anteilrücknahmen		(31.571.913)
Dividendenausschüttung	7	(765.603)
Kapitalbewegungen insgesamt		24.031.893
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		133.050.707

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
GBP	133.050.707	98.246.818	127.452.839

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	11.757.619
Bankguthaben	2	1.300.168
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		82.904
Aktiva insgesamt		13.140.691
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(13.701)
Nicht realisierte Kapitalertragsteuer auf Anlage		(39.156)
Andere Verbindlichkeiten		(3.837)
Passiva insgesamt		(56.694)
Nettovermögen insgesamt		13.083.997

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse IU	3.668.852,019
Klasse ZU	54.028,673

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse IU	3,51	3,65	4,92
Klasse ZU	3,52	3,65	4,92

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		14.607.556
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	291.538
Zinsen aus Bankguthaben	2	3.164
Erträge insgesamt		294.702
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(88.610)
Bankspesen		(38)
Sonstige Betriebskosten	5	(24.811)
Aufwendungen insgesamt		(113.459)
Nettoertrag aus Anlagen		181.243
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(966.213)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.670
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(19.210)
Realisierter Netto(verlust)		(983.753)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		216.588
Nettoveränderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Kapitalertragssteuer		(59)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		216.529
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(585.981)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		400.000
Anteilrücknahmen		(1.337.578)
Kapitalbewegungen insgesamt		(937.578)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		13.083.997

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	13.083.997	14.607.556	20.177.130

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - STANLIB Global Emerging Markets Property Securities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	6.942.122
Bankguthaben	2	2.235.285
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		24.524
Aktiva insgesamt		9.201.931
Passiva		
Kontokorrentkredite		(2.196.773)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(56.343)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(10.238)
Andere Verbindlichkeiten		(2.866)
Passiva insgesamt		(2.266.220)
Nettovermögen insgesamt		6.935.711

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse IU	654.703,660
-----------	-------------

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse IU	10,59	9,87	10,88

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		18.244.936
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	323.997
Zinsen aus Bankguthaben	2	17.100
Erträge insgesamt		341.097
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(105.060)
Bankspesen		(9.595)
Sonstige Betriebskosten	5	(29.417)
Aufwendungen insgesamt		(144.072)
Nettoertrag aus Anlagen		197.025
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(434.397)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		7.099
Realisierter Netto(verlust)		(427.298)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		1.438.409
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		1.438.409
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		1.208.136
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		1.071.244
Anteilrücknahmen		(13.588.605)
Kapitalbewegungen insgesamt		(12.517.361)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		6.935.711

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	6.935.711	18.244.936	34.056.538

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	57.605.929
Bankguthaben	2	19.079.529
Termineinlagen	2	95.239.640
Forderungen aus Zeichnungen		140.486
Zinsforderungen aus Swapgeschäften	2	75.358
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		29.780
Sonstige Vermögenswerte		531
Aktiva insgesamt		172.171.253
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(4.061.832)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(312.534)
Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(38.763)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(17.924)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(1.615.031)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(475.473)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Futures	2, 11	(160.513)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(160.039)
Andere Verbindlichkeiten		(38.528)
Passiva insgesamt		(6.880.637)
Nettovermögen insgesamt		165.290.616

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	998.391,109
Klasse AFH	16.340,000
Klasse AGH	2.513.830,785
Klasse AU	810.310,422
Klasse DEH	109.930,389
Klasse DU	184.044,436
Klasse IEH	1.070.021,650
Klasse IGH	1.538.331,593
Klasse IU	79.816,260
Klasse ZGH	14.586,944

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEH	16,20 ¹	16,30 ¹	16,55 ¹
Klasse AFH	14,98 ²	15,11 ²	15,45 ²
Klasse AGH	16,59 ³	16,61 ³	16,83 ³
Klasse AU	16,50	16,48	16,70
Klasse DEH	12,83 ¹	12,94 ¹	13,20 ¹
Klasse DU	12,98	13,00	13,18
Klasse IEH	22,55 ¹	22,58 ¹	22,84 ¹
Klasse IGH	23,06 ³	22,98 ³	23,12 ³
Klasse IU	22,86	22,73	23,01
Klasse ZGH	15,80 ³	15,75 ³	15,77 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.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		169.573.697
Erträge		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	243.912
Zinsen aus Bankguthaben	2	170.733
Zinsen aus Swaps		53.766
Erträge insgesamt		468.411
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(998.352)
Bankspesen		(1.761)
Dividendenausschüttung Aufwendungen		(125.755)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(85.281)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(239)
Sonstige Betriebskosten	5	(249.852)
Aufwendungen insgesamt		(1.461.240)
Netto(verlust) aus Anlagen		(992.829)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		1.785.381
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(1.006.865)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(7.712.018)
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(1.572.604)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		40.188
Realisierter Netto(verlust)		(8.465.918)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		1.897.148
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(344.393)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(4.337.922)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Futures		599.528
Nettoänderung bei nicht realisiertem (Verlust)		(2.185.639)
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(11.644.386)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		35.227.895
Anteilrücknahmen		(27.866.590)
Kapitalbewegungen insgesamt		7.361.305
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		165.290.616

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	165.290.616	169.573.697	118.097.208

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia*

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	9.098.785
Bankguthaben	2	774.609
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		238
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2.10	31.593
Aktiva insgesamt		9.905.225
Passiva		
Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(9.429)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus		
Devisenterminkontrakten	2, 9	(12.792)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(8.012)
Andere Verbindlichkeiten		(1.714)
Passiva insgesamt		(31.947)
Nettovermögen insgesamt		9.873.278

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEC	112.184,900
Klasse AEH	113.184,900
Klasse DEH	112.184,900
Klasse IEH	112.184,900
Klasse IGH	93.695,600
Klasse ISH	1.344,800
Klasse IU	124.625,000
Klasse IVH	1.336,600
Klasse ZEH	112.184,900
Klasse ZFH	975,500
Klasse ZU	124.625,000

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

30. September 2016

Klasse AEC [#]	9,80 ¹
Klasse AEH [#]	9,80 ¹
Klasse DEH [#]	9,79 ¹
Klasse IEH [#]	9,82 ¹
Klasse IGH [#]	9,84 ²
Klasse ISH [#]	9,84 ³
Klasse IU [#]	9,85
Klasse IVH [#]	9,85 ⁴
Klasse ZEH [#]	9,81 ¹
Klasse ZFH [#]	9,80 ⁵
Klasse ZU [#]	9,84

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 den Abrechnungszeitraum vom 19. Juli 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		–
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	2.623
Zinsen aus Bankguthaben	2	1.069
Erträge insgesamt		3.692
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(19.687)
Bankspesen		(604)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(22.614)
Sonstige Betriebskosten	5	(4.211)
Aufwendungen insgesamt		(47.116)
Netto(verlust) aus Anlagen		(43.424)
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(28)
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(144.700)
Realisierter Nettogewinn aus		
Devisenterminkontrakten		107.708
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(8.233)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		29
Realisierter Netto(verlust)		(45.224)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		2.363
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		31.593
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(12.792)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		21.164
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(67.484)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		9.940.762
Kapitalbewegungen insgesamt		9.940.762
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		9.873.278

GESAMTNETTOINVENTARWERT

30. September 2016

USD 9.873.278

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	43.725.956
Bankguthaben	2	3.242.640
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		127.759
Forderungen aus Zeichnungen		7.172
Erhaltene Vermögensverwaltungsgebühr	2	4.379
Zinsforderungen aus Swapgeschäften	2	10.936
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		607.817
Vorauszahlung aus Swaps		113.072
Sonstige Vermögenswerte		27.539
Aktiva insgesamt		47.867.270
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(2.182.977)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(678.119)
Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(31.409)
Eingegangene Vorauszahlung aus Swaps		(96.262)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(162.412)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(673.969)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Futures	2, 11	(121.152)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(33.945)
Andere Verbindlichkeiten		(9.104)
Passiva insgesamt		(3.989.349)
Nettovermögen insgesamt		43.877.921

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	189.460,243
Klasse AGH	146.968,318
Klasse AU	61.941,255
Klasse DEH	292.372,845
Klasse DU	390.193,790
Klasse IEH	963.667,627
Klasse IFH	12.500,000
Klasse IU	265.017,826
Klasse ZGH	3.495,405

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEH	15,00 ¹	15,34 ¹	16,58 ¹
Klasse AFH	—	—	15,24 ²
Klasse AGH	15,40 ³	15,68 ³	16,84 ³
Klasse AU	15,38	15,62	16,79
Klasse DEH	11,68 ¹	11,99 ¹	13,07 ¹
Klasse DU	11,94	12,18	13,20
Klasse IEH	20,66 ¹	21,07 ¹	22,66 ¹
Klasse IFH	18,61 ²	19,02 ²	20,63 ²
Klasse IGH	—	—	23,08 ³
Klasse IU	21,17	21,44	22,93
Klasse ZGH	14,45 ³	14,67 ³	15,68 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.

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		64.319.469
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	939.353
Zinsen aus Bankguthaben	2	18.062
Zinsen aus Swaps		165.413
Zinsen aus Futures		67
Rückerstattungen der Vermögensverwaltungsgebühr	2	29.553
Erträge insgesamt		1.152.448
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(255.631)
Bankspesen		(4.373)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(489.212)
Zinsaufwand aus Finanztermingeschäften		(2.105)
Sonstige Betriebskosten	5	(65.787)
Sonstige Gebühren	4	(9.330)
Aufwendungen insgesamt		(826.438)
Nettoertrag aus Anlagen		326.010
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(1.138.250)
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		356.281
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(690.779)
Realisierter Netto(verlust) aus Futures		(1.490.623)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		189.158
Realisierter Netto(verlust)		(2.774.213)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		1.385.468
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(658.169)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(347.747)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Futures		101.654
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		481.206
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(1.966.997)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		876.991
Anteilrücknahmen		(19.351.542)
Kapitalbewegungen insgesamt		(18.474.551)
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		43.877.921

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	43.877.921	64.319.469	111.498.163

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha*

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 EUR
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	6.352.687
Bankguthaben	2	2.707.596
Termineinlagen	2	9.499.136
Zinsforderungen aus Swapgeschäften	2	101.889
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2.10	59.667
Aktiva insgesamt		18.720.975
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.533.030)
Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(97.445)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(5.379)
Zahlbare Zinsen und Dividenden, netto		(704)
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(37.519)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Futures	2, 11	(30.000)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(1.403)
Verbindlichkeiten aus Performancegebühren	8	(1.672)
Andere Verbindlichkeiten		(870)
Passiva insgesamt		(1.708.022)
Nettovermögen insgesamt		17.012.953

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AE	73.762,100
Klasse AEP	73.762,100
Klasse AUH	4.391,900
Klasse DE	73.762,100
Klasse IE	73.762,100
Klasse IGH	383,300
Klasse LE	73.762,100
Klasse XGH	1.081.688,436
Klasse ZE	73.762,100
Klasse ZGH	383,300

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

30. September 2016

Klasse AE [#]	10,01
Klasse AEP [#]	10,01
Klasse AUH [#]	10,02 ¹
Klasse DE [#]	10,01
Klasse IE [#]	10,02
Klasse IGH [#]	10,02 ²
Klasse LE [#]	10,02
Klasse XGH [#]	10,02 ²
Klasse ZE [#]	10,02
Klasse ZGH [#]	10,02 ²

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 20. September 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 EUR
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		–
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(1.403)
Performancegebühren	8	(1.672)
Bankspesen		(1.753)
Dividendenausschüttung Aufwendungen		(5.379)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(307)
Sonstige Betriebskosten	5	(870)
Aufwendungen insgesamt		(11.384)
Netto(verlust) aus Anlagen		(11.384)
Realisierter Netto(verlust) aus Anlagen		(4.952)
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		4.863
Realisierter Nettogewinn aus Futures		5.382
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(394)
Realisierter Nettogewinn		4.899
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		11.365
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		59.667
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(37.519)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Futures		(30.000)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		3.513
Netto(verminderung) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit		(2.972)
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		17.015.925
Kapitalbewegungen insgesamt		17.015.925
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		17.012.953

GESAMTNETTOINVENTARWERT

30. September 2016

EUR 17.012.953

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Aktiva		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	355.174.297
Bankguthaben	2	23.339.828
Forderungen aus Zeichnungen		626.016
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		3.075
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2.10	9.484.357
Aktiva insgesamt		388.627.573
Passiva		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(346.969)
Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften	2	(30.222)
Nicht realisierter Nettoverlust aus		
Devisenterminkontrakten	2, 9	(1.978.090)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	5	(294.209)
Andere Verbindlichkeiten		(79.074)
Passiva insgesamt		(2.728.564)
Nettovermögen insgesamt		385.899.009

ANZAHL DER AUSSTEHENDEN AKTIEN

Klasse AEH	478.488,191
Klasse AFH	146.176,675
Klasse AGH	101.157,692
Klasse ASH	202.225,789
Klasse AU	1.173.291,931
Klasse DEH	352.168,321
Klasse DU	181.294,776
Klasse IEH	1.456.265,732
Klasse IFH	25.000,000
Klasse IGH	4.113.917,703
Klasse IKH	6.164.542,134
Klasse IU	8.706.341,218
Klasse XGH	109.615,070
Klasse XU	2.598.189,893
Klasse ZEH	336.256,759
Klasse ZFH	126.080,000
Klasse ZGH	1.135.233,993
Klasse ZU	447.848,115

AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
Klasse AEH	9,80 ¹	9,12 ¹	11,48 ¹
Klasse AFH	7,35 ²	6,86 ²	8,70 ²
Klasse AGH	10,14 ³	9,43 ³	11,80 ³
Klasse ASH	5,12 ⁴	4,73 ⁴	5,88 ⁴
Klasse AU	10,38	9,58	11,94
Klasse DEH	7,61 ¹	7,10 ¹	8,99 ¹
Klasse DU	8,06	7,46	9,35
Klasse IEH	13,79 ¹	12,79 ¹	15,97 ¹
Klasse IFH	10,33 ²	9,60 ²	12,07 ²
Klasse IGH	14,23 ³	13,18 ³	16,35 ³
Klasse IKH	106,82 ⁵	99,34 ⁵	124,46 ⁵
Klasse IU	14,59	13,41	16,57
Klasse XGH	13,54 ³	12,46 ³	15,29 ³
Klasse XU	14,79	13,51	16,52
Klasse ZEH	5,82 ¹	5,40 ¹	6,76 ¹
Klasse ZFH	5,72 ²	5,31 ²	6,74 ²
Klasse ZGH	8,16 ³	7,54 ³	9,34 ³
Klasse ZU	6,02	5,52	6,81

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

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für den Abrechnungszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Erläuterungen	2016 USD
Nettovermögen zu Beginn des Zeitraums		301.823.229
Erträge		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	379.142
Zinsen aus Bankguthaben	2	24.582
Erträge insgesamt		403.724
Aufwendungen		
Verwaltungsgebühren	5	(1.650.819)
Bankspesen		(7.451)
Zinsaufwand aus Swapgeschäften		(343.768)
Sonstige Betriebskosten	5	(433.636)
Sonstige Gebühren	4	(137)
Aufwendungen insgesamt		(2.435.811)
Netto(verlust) aus Anlagen		(2.032.087)
Realisierter Nettogewinn aus Anlagen		118.070
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		18.094.338
Realisierter Netto(verlust) aus		
Devisenterminkontrakten		(10.304.374)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(120.702)
Realisierter Nettogewinn		7.787.332
Änderung des nicht realisierten		
Nettogewinns aus Anlagen		183.017
Änderung des nicht realisierten		
Nettogewinns aus Swaps		11.427.068
Änderung des nicht realisierten Netto-		
(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(6.160.337)
Nettoänderung bei nicht realisiertem Gewinn		5.449.748
Nettoerhöhung des Nettovermögens aus		
Geschäftstätigkeit		11.204.993
Kapitalbewegungen		
Zeichnungen von Anteilen		136.591.656
Anteilrücknahmen		(63.720.869)
Kapitalbewegungen insgesamt		72.870.787
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode		385.899.009

GESAMTNETTOINVENTARWERT

	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
USD	385.899.009	301.823.229	343.675.888

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen					Anleihen (Fortsetzung)				
AUSTRALIEN					IRLAND (Fortsetzung)				
EUR	60.000	Santos Finance Limited FRN 22/09/2070	70.417	0,33	USD	200.000	Vnesheconombank Via Veb Finance plc 5.94% 21/11/2023	211.866	1,01
USD	200.000	SGSP Australia Assets Pty Limited 3.30% 09/04/2023	207.422	0,99			Summe Irland	634.819	3,03
		Summe Australien	277.839	1,32					
BELGIEN					ITALIEN				
EUR	100.000	KBC Groep NV FRN 19/12/2049	109.983	0,52	EUR	200.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3.50% 20/03/2017	228.074	1,09
		Summe Belgien	109.983	0,52			Summe Italien	228.074	1,09
KANADA					MEXIKO				
USD	75.000	Barrick Gold Corp. 5.25% 01/04/2042	82.520	0,39	USD	370.000	Petroleos Mexicanos 5.50% 04/02/2019	391.415	1,86
USD	77.000	Xstrata Finance Canada Limited 4.95% 15/11/2021	81.183	0,39			Summe Mexiko	391.415	1,86
		Summe Kanada	163.703	0,78					
KAIMANINSELN					NIEDERLANDE				
USD	67.000	Noble Holding International Limited 5.25% 15/03/2042	38.900	0,19	USD	75.000	LYB International Finance BV 4.88% 15/03/2044	81.200	0,39
USD	35.000	Noble Holding International Limited 6.95% 01/04/2045	24.665	0,12			Summe Niederlande	81.200	0,39
		Summe Kaimaninseln	63.565	0,31					
DÄNEMARK					PORTUGAL				
GBP	25.000	Danske Bank FRN 29/09/2021	34.524	0,16	EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2019	25.847	0,12
		Summe Dänemark	34.524	0,16			Summe Portugal	25.847	0,12
					SCHWEIZ				
					USD	200.000	UBS Group AG FRN 29/12/2049	211.998	1,01
							Summe Schweiz	211.998	1,01
GEORGIEN					VEREINIGTES KÖNIGREICH				
USD	285.000	Georgian Railway JSC 7.75% 11/07/2022	322.214	1,54	USD	272.000	Barclays plc 4.38% 11/09/2024	275.404	1,31
		Summe Georgien	322.214	1,54	GBP	100.000	Bupa Finance plc 5.00% 25/04/2023	142.167	0,68
					GBP	50.000	Legal & General Group plc FRN 23/07/2041	85.074	0,41
GUERNSEY - KANALINSELN					GBP	100.000	Pennon Group plc FRN 08/03/2049	136.174	0,65
GBP	165.000	Credit Suisse 2.75% 08/08/2025	212.871	1,01	USD	177.000	Royal Bank of Scotland 6.13% 15/12/2022	187.924	0,90
		Summe Guernsey - Kanalinseln	212.871	1,01			Summe Vereinigtes Königreich	826.743	3,95
IRLAND					VEREINIGTE STAATEN				
EUR	100.000	Allied Irish Banks FRN 26/11/2025	108.616	0,52	USD	180.000	AT&T Inc. 4.13% 17/02/2026	194.875	0,92
EUR	200.000	Bank of Ireland FRN 29/12/2049	215.268	1,03	USD	80.000	AT&T Inc. 4.30% 15/12/2042	79.356	0,38
JPY	10.000.000	DePfa ACS Bank 1.65% 20/12/2016	99.069	0,47	USD	178.000	Columbia Pipeline Group Inc. 5.80% 01/06/2045	212.034	1,01

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

			Marktwert	% des				Marktwert	% des
Nennwert	Anlage		USD	Netto- vermögens	Nennwert	Anlage		USD	Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					KROATIEN				
USD	100.000	Enterprise Products Operating LLC 4.90% 15/05/2046	106.009	0,51	USD	300.000	Croatia (Govt of) 6.00% 26/01/2024	345.336	1,65
USD	105.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	99.114	0,47			Summe Kroatien	345.336	1,65
USD	62.000	L-3 Communications Corp. 3.95% 28/05/2024	66.169	0,32					
USD	54.000	Loews Corp 3.75% 01/04/2026	57.411	0,27	DOMINIKANISCHE REPUBLIK				
USD	60.000	Molson Coors Brewing Company 5.00% 01/05/2042	69.656	0,33	USD	330.000	Dominican (Govt of) 7.50% 06/05/2021	369.854	1,76
USD	125.000	Nisource Finance Corp. 4.80% 15/02/2044	142.378	0,68			Summe Dominikanische Republik	369.854	1,76
USD	65.000	Pacific Gas & Electric Company 4.30% 15/03/2045	73.772	0,35					
USD	70.000	Ppl Capital Fund 3.95% 15/03/2024	75.757	0,36	UNGARN				
USD	184.000	Sempra Energy 3.55% 15/06/2024	194.656	0,93	HUF	190.000.000	Hungary (Govt of) 5.50% 24/06/2025	840.617	4,01
USD	83.000	Verizon Communications Inc. 4.67% 15/03/2055	87.296	0,42	USD	240.000	Mfb Magyar Fejlesztési Bank Zrt 6.25% 21/10/2020	272.142	1,30
USD	75.000	Verizon Communications Inc. 5.01% 21/08/2054	83.091	0,40			Summe Ungarn	1.112.759	5,31
USD	175.000	Williams Partners LP 4.90% 15/01/2045	167.252	0,80	INDONESIEN				
		Summe Vereinigte Staaten	1.708.826	8,15	USD	310.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 08/01/2026	347.257	1,66
Summe Anleihen			5.293.621	25,24	IDR	5.711.000.000	Indonesia (Govt of) 8.75% 15/05/2031	495.613	2,36
							Summe Indonesien	842.870	4,02
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente									
ARGENTINIEN					ITALIEN				
USD	180.000	Argentina (Govt of) 7.50% 22/04/2026	203.298	0,97	EUR	225.000	Italy (Govt of) BPT 1.35% 15/04/2022	265.605	1,27
		Summe Argentinien	203.298	0,97	EUR	275.000	Italy (Govt of) BPT 2.27% 15/09/2021	376.231	1,79
					EUR	65.000	Italy (Govt of) BPT 2.50% 01/12/2024	81.955	0,39
BELGIEN					EUR	604.000	Italy (Govt of) BPT 2.70% 01/03/2047	749.130	3,57
EUR	90.000	Belgium (Govt of) 1.90% 22/06/2038	123.420	0,59	EUR	65.000	Italy (Govt of) BPT 5.00% 01/09/2040	113.321	0,54
		Summe Belgien	123.420	0,59			Summe Italien	1.586.242	7,56
KANADA					ELFENBEINKÜSTE				
CAD	300.000	Canada Housing Trust 1.20% 15/06/2020	230.916	1,10	USD	250.000	Ivory Coast (Govt of) 5.38% 23/07/2024	251.873	1,20
CAD	255.000	Canada Housing Trust 2.55% 15/03/2025	211.652	1,01			Summe Elfenbeinküste	251.873	1,20
CAD	1.125.000	Canadian (Govt of) 1.50% 01/06/2026	895.852	4,27					
		Summe Kanada	1.338.420	6,38					

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				
JAPAN					VEREINIGTE STAATEN				
JPY	21.800.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 1.40% 20/12/2045	271.790	1,30	USD	1.000.000	United States Treasury N/B 0.50% 28/02/2017	1.000.430	4,77
JPY	43.000.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 1.60% 20/06/2045	557.633	2,66	Summe Vereinigte Staaten			1.000.430	4,77
Summe Japan			829.423	3,96	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente			10.292.825	49,10
PORTUGAL					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				
EUR	893.000	Portugal (Govt of) OT 3.88% 15/02/2030	1.010.729	4,83				15.586.446	74,34
Summe Portugal			1.010.729	4,83					
RUSSISCHE FÖDERATION					Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt				
RUB	19.676.000	Russian Federal Bond - Ofz 8.15% 03/02/2027	315.697	1,51	Anleihen				
Summe Russische Föderation			315.697	1,51	VEREINIGTE STAATEN				
SPANIEN					USD	155.000	Five Corners Funding P.P. 144A 4.42% 15/11/2023	167.297	0,80
USD	150.000	Instituto de Credito Oficial 5.00% 14/11/2016	150.614	0,72	USD	65.000	Insurance and Annuity Association 4.90% 15/09/2044	73.536	0,35
EUR	36.000	Spain (Govt of) 2.15% 31/10/2025	45.176	0,22	USD	20.000	Private Export Funding Corp. 5.45% 15/09/2017	20.843	0,10
EUR	70.000	Spain (Govt of) BOE 1.95% 30/04/2026	86.375	0,41	Summe Vereinigte Staaten			261.676	1,25
EUR	30.000	Spain (Govt of) BOE 5.15% 31/10/2044	57.270	0,27	Summe Anleihen			261.676	1,25
Summe Spanien			339.435	1,62	Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen				
SUPRANATIONAL					VEREINIGTE STAATEN				
EUR	187.000	European Union 0.63% 04/11/2023	224.562	1,07	USD	143.385	Fannie Mae Pool 3.50% 01/04/2026	151.332	0,72
Summe Supranational			224.562	1,07	USD	201.677	Fannie Mae Pool 3.50% 01/12/2041	217.636	1,04
VEREINIGTES KÖNIGREICH					USD	28.680	Fannie Mae Pool 4.50% 01/11/2035	31.555	0,15
GBP	150.000	United Kingdom Gilt 3.25% 22/01/2044	271.653	1,30	USD	88.915	Fannie Mae Pool 4.50% 01/06/2038	98.148	0,47
GBP	55.000	United Kingdom Gilt 3.50% 22/07/2068	126.824	0,60	USD	9.126	Fannie Mae Pool 6.00% 01/11/2036	10.528	0,05
Summe Vereinigtes Königreich			398.477	1,90	USD	151.836	Freddie Mac Gold Pool 3.50% 01/02/2041	161.402	0,76
					USD	97.348	Freddie Mac Gold Pool 3.50% 01/04/2042	103.986	0,50
					USD	76.637	Freddie Mac Gold Pool 4.00% 01/06/2031	82.953	0,40
					USD	84.278	Freddie Mac Gold Pool 4.00% 01/04/2041	92.429	0,44

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
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt (Fortsetzung)					Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren				
Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen (Fortsetzung)					Fonds				
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					LUXEMBURG				
USD	104.358	Freddie Mac Gold Pool 4.00% 01/08/2041	109.375	0,52	57.160	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond Portfolio		1.786.257	8,52
Summe Vereinigte Staaten			1.059.344	5,05	Summe Luxemburg			1.786.257	8,52
Summe Forderungs- und hypothekenbesicherte Wertpapiere			1.059.344	5,05	Summe Fonds			1.786.257	8,52
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente					Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren				
					Wert der Anlagen insgesamt			1.786.257	8,52
					(Gesamtkosten: USD 19.766.952)			20.537.349	97,95
RUSSISCHE FÖDERATION									
RUB	103.927.000	Russia (Govt of) 7.50% 18/08/2021	1.602.626	7,64					
Summe Russische Föderation			1.602.626	7,64					
VEREINIGTE STAATEN									
USD	175.000	Port Authority of New York & New Jersey 4.46% 01/10/2062	201.556	0,96					
Summe Vereinigte Staaten			201.556	0,96					
Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente			1.804.182	8,60					
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt									
			3.125.202	14,90					
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente									
Anleihen									
VEREINIGTE STAATEN									
USD	40.000	Massachusetts Mutual Life Insurance Company P.P. 144A 4.50% 15/04/2065	39.444	0,19					
Summe Vereinigte Staaten			39.444	0,19					
Summe Anleihen			39.444	0,19					
Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			39.444	0,19					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)						
Anleihen					Anleihen (Fortsetzung)						
AUSTRALIEN					KAIMANINSELN (Fortsetzung)						
EUR	125.000	Apt Pipelines Limited 2.00% 22/03/2027	145.309	0,60	USD	42.000	Noble Holding International Limited 6.95% 01/04/2045	29.597	0,12		
GBP	100.000	Asciano Finance Limited 5.00% 19/09/2023	148.558	0,62	GBP	140.000	Thames Water Utilities Cayman Finance Limited FRN 21/07/2025	187.475	0,78		
EUR	124.000	Aurizon Network Pty Limited 2.00% 18/09/2024	146.799	0,60	USD	104.000	Vale Overseas Limited 4.38% 11/01/2022	103.411	0,43		
EUR	100.000	BHP Billiton Finance Limited FRN 22/10/2079	127.229	0,53	GBP	119.000	Yorkshire Water FRN 24/04/2025	158.375	0,66		
EUR	75.000	Santos Finance Limited FRN 22/09/2070	88.022	0,36	Summe Kaimaninseln			569.262	2,36		
USD	200.000	SGSP Australia Assets Pty Limited 3.25% 29/07/2026	204.311	0,85	DÄNEMARK						
EUR	238.000	SGSP Australia Assets Pty Limited 2.00% 30/06/2022	290.227	1,20	GBP	47.000	Danske Bank FRN 29/09/2021	64.905	0,27		
USD	190.000	Woodside Finance Limited 3.65% 05/03/2025	192.374	0,81	EUR	100.000	ISS Global A/S 2.13% 02/12/2024	124.138	0,52		
Summe Australien			1.342.829	5,57	Summe Dänemark					189.043	0,79
ÖSTERREICH					FRANKREICH						
EUR	100.000	Bawag PSK 8.13% 30/10/2023	141.901	0,59	EUR	100.000	BPCE SA 1.00% 05/10/2028	112.627	0,47		
EUR	100.000	Erste Group Bank AG 7.13% 10/10/2022	141.506	0,59	EUR	100.000	Klepierre 1.25% 29/09/2031	115.214	0,48		
EUR	100.000	Hypo Alpe-Adria-Bank International AG - ADR 4.38% 24/01/2017	99.185	0,41	EUR	100.000	Numericable Group SA 5.38% 15/05/2022	116.373	0,48		
Summe Österreich			382.592	1,59	Summe Frankreich					344.214	1,43
BELGIEN					DEUTSCHLAND						
EUR	100.000	KBC Groep NV FRN 19/12/2049	109.983	0,46	EUR	150.000	Crh Finance Germany GmbH 1.75% 16/07/2021	180.318	0,75		
Summe Belgien			109.983	0,46	EUR	60.000	Heidelbergcement AG 2.25% 03/06/2024	71.158	0,29		
KANADA					EUR	100.000	Schaeffler 3.25% 15/09/2023	112.339	0,47		
USD	70.000	Barrick Gold Corp. 5.25% 01/04/2042	77.019	0,32	EUR	100.000	Unitymedia Hessen GmbH & Company KG 4.00% 15/01/2025	115.985	0,48		
USD	150.000	Canadian Natural Resources Limited 3.80% 15/04/2024	150.775	0,62	Summe Deutschland			479.800	1,99		
USD	28.000	Canadian Natural Resources Limited 6.25% 15/03/2038	31.554	0,13	GUERNSEY - KANALINSELN						
USD	75.000	Cenovus Energy Inc. 4.45% 15/09/2042	62.625	0,26	GBP	100.000	Credit Suisse 2.75% 08/08/2025	129.013	0,53		
Summe Kanada			321.973	1,33	USD	250.000	Credit Suisse 4.55% 17/04/2026	263.122	1,10		
KAIMANINSELN					Summe Guernsey - Kanalinseln					392.135	1,63
USD	82.000	Noble Holding International Limited 3.95% 15/03/2022	60.794	0,25	ISLAND						
USD	51.000	Noble Holding International Limited 5.25% 15/03/2042	29.610	0,12	EUR	100.000	Arion Banki hf 2.50% 26/04/2019	116.454	0,48		
					Summe Island			116.454	0,48		

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Anleihen (Fortsetzung)				
IRLAND					PORTUGAL				
EUR	130.000	Bank of Ireland FRN 11/06/2024	145.609	0,60	EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2019	25.847	0,11
EUR	100.000	FCA Capital Ireland plc 1.38% 17/04/2020	115.660	0,48			Summe Portugal	25.847	0,11
USD	200.000	GE Capital International Funding Company 4.42% 15/11/2035	225.131	0,93	SCHWEDEN				
		Summe Irland	486.400	2,01	EUR	100.000	Atlas Copco AB 0.63% 30/08/2026	112.996	0,47
							Summe Schweden	112.996	0,47
JERSEY - KANALINSELN					SCHWEIZ				
GBP	50.000	UBM plc 6.50% 23/11/2016	65.412	0,27	EUR	100.000	UBS AG FRN 12/02/2026	120.125	0,50
		Summe Jersey - Kanalinseln	65.412	0,27			Summe Schweiz	120.125	0,50
LUXEMBURG					VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				
USD	140.000	Actavis Funding SCS 3.80% 15/03/2025	148.406	0,61	EUR	146.000	Emirates NBD PJSC 1.75% 23/03/2022	165.301	0,68
GBP	140.000	Glencore Finance Europe SA 6.00% 03/04/2022	206.734	0,86			Summe Vereinigte Arabische Emirate	165.301	0,68
EUR	200.000	Grand City Properties 1.50% 17/04/2025	232.185	0,96					
		Summe Luxemburg	587.325	2,43	VEREINIGTES KÖNIGREICH				
NIEDERLANDE					GBP	70.000	Barclays Bank 10.00% 21/05/2021	117.435	0,49
EUR	100.000	Alliander NV 0.88% 22/04/2026	117.835	0,49	EUR	175.000	British Telecommunications plc 1.13% 10/03/2023	205.896	0,85
EUR	100.000	Eneco Holding NV FRN 29/12/2049	116.033	0,48	GBP	125.000	Bupa Finance plc 3.38% 17/06/2021	176.994	0,73
EUR	238.000	Enexis Holding NV 1.50% 20/10/2023	291.777	1,21	USD	200.000	Centrica plc 4.00% 16/10/2023	212.118	0,87
EUR	40.000	Evonik Finance BV 0.38% 07/09/2024	44.652	0,18	GBP	110.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	190.785	0,80
EUR	200.000	Jab Holdings BV 1.75% 25/05/2023	240.553	0,99	GBP	98.967	Greene King Finance 4.06% 15/03/2035	142.353	0,59
USD	75.000	LYB International Finance BV 4.88% 15/03/2044	81.200	0,34	GBP	40.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	63.953	0,26
GBP	49.000	Postnl NV 7.50% 14/08/2018	71.613	0,30	EUR	100.000	HSBC Holdings plc 0.88% 06/09/2024	112.068	0,46
GBP	80.000	RWE Finance BV 6.25% 03/06/2030	141.684	0,59	GBP	50.000	Imperial Tobacco Finance plc 7.75% 24/06/2019	76.543	0,32
EUR	100.000	SNS Bank NV FRN 05/11/2025	114.715	0,48	GBP	100.000	Legal & General FRN 27/10/2045	137.385	0,57
EUR	145.000	Tennet Holding BV 1.88% 13/06/2036	186.370	0,77	GBP	79.000	Lloyds TSB Bank plc 7.63% 22/04/2025	136.079	0,56
EUR	100.000	Vonovia Finance BV 1.50% 10/06/2026	118.549	0,49	EUR	100.000	National Grid Gas 0.63% 22/09/2024	113.385	0,47
EUR	100.000	Vonovia Finance BV FRN 29/12/2049	119.299	0,49	GBP	100.000	National Grid Gas 2.13% 22/09/2028	134.051	0,56
		Summe Niederlande	1.644.280	6,81	GBP	100.000	National Grid Gas 2.63% 22/09/2038	135.483	0,56

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

			Marktwert	% des Netto- vermögens				Marktwert	% des Netto- vermögens
Nennwert	Anlage		USD		Nennwert	Anlage		USD	
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Anleihen (Fortsetzung)				
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				
EUR	230.000	Ngg Finance plc FRN 18/06/2076	278.829	1,16	USD	149.000	Concho Resources Inc. 5.50% 01/04/2023	155.113	0,64
GBP	100.000	Pennon Group plc FRN 08/03/2049	136.174	0,56	EUR	100.000	Digital Euro Finco LLC 2.63% 15/04/2024	119.756	0,50
USD	200.000	Royal Bank of Scotland 8.63% 29/12/2049	198.109	0,82	USD	85.000	Discover Financial Services 3.85% 21/11/2022	88.045	0,36
GBP	132.000	Safeway Limited 6.00% 10/01/2017	173.578	0,72	USD	306.000	Dte Energy Company 3.85% 01/12/2023	333.517	1,39
USD	90.000	Sky plc 3.13% 26/11/2022	92.251	0,38	USD	175.000	Duke Energy Progress Inc. 4.20% 15/08/2045	195.600	0,81
GBP	100.000	Telereal 4.09% 10/12/2033	136.111	0,56	CHF	100.000	Eli Lilly & Company 0.15% 24/05/2024	105.650	0,44
GBP	46.935	Telereal 4.97% 10/09/2027	70.383	0,29	USD	137.000	Enterprise Products Operating LLC 4.90% 15/05/2046	145.232	0,60
GBP	98.883	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	130.104	0,54	EUR	50.000	Fiat Finance North America 5.63% 12/06/2017	58.061	0,24
GBP	100.000	Tsb Banking Group plc 5.75% 06/05/2026	137.222	0,57	USD	50.000	Florida Power & Light Company 4.05% 01/10/2044	56.460	0,23
GBP	100.000	Unite USAF II plc 3.92% 30/06/2025	151.507	0,63	GBP	100.000	HJ Heinz Company 4.13% 01/07/2027	152.149	0,63
GBP	100.000	Western Power Distribution 3.63% 06/11/2023	144.492	0,60	USD	81.000	Indiana Michigan Power Company 6.05% 15/03/2037	102.581	0,42
		Summe Vereinigtes Königreich	3.603.288	14,92	USD	110.000	Kinder Morgan Energy Partners Lp 4.30% 01/05/2024	113.706	0,47
VEREINIGTE STAATEN					USD	142.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	134.039	0,56
USD	88.000	Aetna Inc. 4.38% 15/06/2046	91.904	0,38	EUR	100.000	Kinder Morgan Inc. 2.25% 16/03/2027	113.694	0,47
USD	75.000	Anadarko Petroleum Corp 3.45% 15/07/2024	74.454	0,31	USD	60.000	L-3 Communications Corp. 3.95% 28/05/2024	64.034	0,27
USD	3.000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc. 2.63% 17/01/2023	3.064	0,01	USD	102.000	L-3 Communications Corp. 5.20% 15/10/2019	111.832	0,46
USD	150.000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc. 4.70% 01/02/2036	173.376	0,72	EUR	210.000	Liberty Mutual Group 2.75% 04/05/2026	255.092	1,05
USD	100.000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc. 4.90% 01/02/2046	120.318	0,50	USD	85.000	Lockheed Martin Corp. 4.50% 15/05/2036	97.570	0,40
USD	383.000	AT&T Inc. 4.30% 15/12/2042	379.916	1,57	USD	50.000	Loews Corp 3.75% 01/04/2026	53.159	0,22
USD	109.000	Bank of America Corp. 4.13% 22/01/2024	118.371	0,49	USD	136.000	Loews Corp. 2.63% 15/05/2023	137.948	0,57
USD	100.000	Berkshire Hathaway 3.13% 15/03/2026	105.322	0,44	USD	135.000	Microsoft Corp. 3.45% 08/08/2036	137.950	0,57
EUR	254.000	Berkshire Hathaway Inc. 1.13% 16/03/2027	291.920	1,21	EUR	100.000	Molson Coors Brewing Company 1.25% 15/07/2024	115.895	0,48
EUR	100.000	Celanese US 1.13% 26/09/2023	113.386	0,47	USD	40.000	Molson Coors Brewing Company 5.00% 01/05/2042	46.437	0,19
USD	80.000	Celanese US Holdings LLC 5.88% 15/06/2021	91.702	0,38	USD	130.000	Nisource Finance Corp. 4.80% 15/02/2044	148.073	0,61
USD	120.000	CMS Energy Corp 3.60% 15/11/2025	128.246	0,53	USD	95.000	Pacific Gas & Electric Company 4.30% 15/03/2045	107.820	0,45
USD	140.000	CMS Energy Corp. 6.25% 01/02/2020	159.705	0,66	USD	50.000	Plains All American Pipeline 4.70% 15/06/2044	44.124	0,18
USD	123.000	Columbia Pipeline Group Inc. 5.80% 01/06/2045	146.517	0,60					
USD	100.000	Conagra Foods Inc. 3.20% 25/01/2023	104.310	0,43					

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				
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)								
Anleihen (Fortsetzung)					Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)								
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					VEREINIGTE STAATEN								
USD	140.000	Plains All American Pipeline LP 4.65% 15/10/2025	145.338	0,60	USD	468.000	United States Treasury N/B 1.63% 15/02/2026	469.353	1,94				
USD	183.000	Plains All American Pipeline LP 4.65% 15/10/2025	189.979	0,80	USD	120.000	United States Treasury N/B 2.50% 15/02/2046	124.547	0,52				
USD	100.000	Regions Financials Company 3.20% 08/02/2021	104.100	0,43	Summe Vereinigte Staaten		593.900	2,46					
USD	275.000	Sabmiller Holdings Inc. P.P. 144A 3.75% 15/01/2022	298.594	1,24	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente								
USD	100.000	Scripps Networks 3.95% 15/06/2025	105.699	0,44	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind								
USD	127.000	Scripps Networks Interactive Inc. 2.80% 15/06/2020	130.112	0,54	19.197.42979,54								
USD	88.000	Sempra Energy 3.55% 15/06/2024	93.097	0,39	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt								
USD	115.000	Southern Company 4.40% 01/07/2046	124.936	0,52	Anleihen								
USD	47.000	Synovus Financial Corp. 7.88% 15/02/2019	52.288	0,22	BERMUDAS								
USD	50.000	Time Warner Cable Inc. 4.50% 15/09/2042	48.032	0,20	USD	100.000	Bacardi Limited 2.75% 15/07/2026	99.537	0,41				
USD	105.000	Transcontinental Gas Pipe Line Company LLC 7.85% 01/02/2026	136.253	0,56	Summe Bermudas		99.537	0,41					
USD	183.000	Verizon Communications Inc. 4.67% 15/03/2055	192.472	0,80	NIEDERLANDE								
USD	67.000	Verizon Communications Inc. 5.01% 21/08/2054	74.228	0,31	USD	204.000	Deutsche Annington Finance BV 5.00% 02/10/2023	224.400	0,93				
GBP	100.000	Wells Fargo & Company 2.00% 28/07/2025	130.583	0,54	Summe Niederlande		224.400	0,93					
USD	189.000	Williams Partners LP 4.90% 15/01/2045	180.633	0,75	VEREINIGTE STAATEN								
Summe Vereinigte Staaten		7.302.392	30,25	USD					250.000	Five Corners Funding P.P. 144A 4.42% 15/11/2023	269.833	1,12	
BRITISCHE JUNGFERNINSELN					USD					134.000	Insurance and Annuity Association 4.90% 15/09/2044	151.598	0,63
GBP	100.000	Global Switch Holdings Limited 4.38% 13/12/2022	146.772	0,61	Summe Vereinigte Staaten		421.431	1,75	Summe Anleihen			745.368	3,09
Summe Britische Jungfernsinseln		146.772	0,61	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt					745.368	3,09			
Summe Anleihen					18.508.42376,69								
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente					VEREINIGTES KÖNIGREICH								
GBP	50.000	United Kingdom Gilt 3.50% 22/01/2045	95.106	0,39	Summe Vereinigtes Königreich					95.106	0,39		
Summe Vereinigtes Königreich		95.106	0,39										

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
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				
Anleihen				
AUSTRALIEN				
USD	60.000	Asciano Finance Limited 5.00% 07/04/2018	62.197	0,26
		Summe Australien	62.197	0,26
KANADA				
CAD	279.000	Rogers Communications Inc. 4.00% 13/03/2024	235.122	0,97
		Summe Kanada	235.122	0,97
FRANKREICH				
USD	200.000	BPCE SA 4.50% 15/03/2025	203.690	0,83
		Summe Frankreich	203.690	0,83
VEREINIGTE STAATEN				
USD	140.000	Bae Systems Holdings Inc. 3.85% 15/12/2025	149.338	0,62
USD	102.000	Erac Usa Finance LLC P.P. 144A 4.50% 15/02/2045	109.119	0,45
USD	200.000	Lafargeholcim Finance US 3.50% 22/09/2026	204.354	0,85
USD	30.000	Massachusetts Mutual Life Insurance Company P.P. 144A 4.50% 15/04/2065	29.583	0,12
USD	175.000	Metropolitan Life Global Funding P.P. 144A 2.30% 10/04/2019	178.596	0,74
CAD	100.000	Molson Coors International LP 2.75% 18/09/2020	78.325	0,32
USD	100.000	Peachtree Fund Trust 3.98% 15/02/2025	100.833	0,42
		Summe Vereinigte Staaten	850.148	3,52
		Summe Anleihen	1.351.157	5,58
		Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	1.351.157	5,58
		Wert der Anlagen insgesamt	21.293.954	88,21
(Gesamtkosten: USD 21.088.339)				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen					Anleihen (Fortsetzung)				
AUSTRALIEN					FRANKREICH				
EUR	200.000	Aurizon Network Pty Limited 2.00% 18/09/2024	210.689	0,30	EUR	150.000	Autoroutes du Sud de la France SA 4.13% 13/04/2020	172.123	0,25
EUR	475.000	BHP Billiton Finance Limited FRN 22/10/2079	537.764	0,78	EUR	200.000	Banque Federative du Credit Mutuel 1.63% 19/01/2026	219.973	0,32
EUR	150.000	Santos Finance Limited FRN 22/09/2070	156.650	0,23	EUR	200.000	BPCE SA 1.00% 05/10/2028	200.440	0,29
EUR	228.000	SGSP Australia Assets Pty Limited 2.00% 30/06/2022	247.403	0,36	EUR	100.000	BPCE SA FRN 30/11/2027	103.783	0,15
EUR	200.000	Spi Electricity & Gas Australia Holdings Pty Limited 2.38% 24/07/2020	217.909	0,31	EUR	200.000	Casino Guichard Perrachon SA 3.99% 09/03/2020	226.479	0,33
		Summe Australien	1.370.415	1,98	EUR	100.000	Credit Agricole SA FRN 23/12/2049	99.961	0,14
ÖSTERREICH					EUR	450.000	Dexia Credit Local SA 0.25% 19/03/2020	456.871	0,66
EUR	200.000	Bawag PSK 8.13% 30/10/2023	252.537	0,36	EUR	1.050.000	Dexia Credit Local SA 0.63% 21/01/2022	1.091.012	1,58
EUR	100.000	Erste Group Bank AG 7.13% 10/10/2022	125.918	0,18	EUR	100.000	Ephios Bondco plc 6.25% 01/07/2022	106.383	0,15
EUR	100.000	Hypo Alpe-Adria-Bank International AG - ADR 4.38% 24/01/2017	88.259	0,13	EUR	100.000	Novalis SAS 3.00% 30/04/2022	100.998	0,15
		Summe Österreich	466.714	0,67	EUR	200.000	Numericable Group SA 5.38% 15/05/2022	207.107	0,30
BELGIEN					EUR	175.000	Orange SA FRN 29/10/2049	185.322	0,27
EUR	150.000	Anheuser-Busch InBev NV 1.95% 30/09/2021	163.956	0,24	EUR	200.000	Orange SA 4.13% 23/01/2019	219.333	0,32
EUR	200.000	Argenta Spaarbank 3.88% 24/05/2026	209.641	0,30	EUR	300.000	Sanef SA 1.88% 16/03/2026	339.607	0,48
EUR	100.000	KBC Groep NV FRN 19/12/2049	97.867	0,14	EUR	200.000	Sanofi 1.13% 10/03/2022	211.584	0,31
		Summe Belgien	471.464	0,68	EUR	300.000	Tdf Infrastructure SAS 2.88% 19/10/2022	335.130	0,48
KAIMANINSELN							Summe Frankreich	4.276.106	6,18
GBP	443.000	Thames Water Utilities Cayman Finance Limited FRN 21/07/2025	527.874	0,77	DEUTSCHLAND				
GBP	200.000	Yorkshire Water FRN 24/04/2025	236.854	0,34	EUR	275.000	Crh Finance Germany GmbH 1.75% 16/07/2021	294.166	0,42
		Summe Kaimaninseln	764.728	1,11	EUR	100.000	Deutsche Raststätten Gruppe IV GmbH 6.75% 30/12/2020	105.002	0,15
DÄNEMARK					EUR	200.000	Eurogrid GmbH 1.63% 03/11/2023	218.711	0,32
GBP	160.000	Danske Bank FRN 29/09/2021	196.611	0,28	EUR	125.000	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 2.38% 10/02/2021	136.495	0,20
EUR	325.000	ISS Global A/S 2.13% 02/12/2024	359.005	0,51	EUR	100.000	Schaeffler 3.25% 15/09/2023	99.964	0,15
DKK	10.000.000	Realkredit Danmark 1.00% 01/04/2020	1.392.463	2,01	EUR	100.000	Unitymedia Kabelbw GmbH 3.75% 15/01/2027	96.116	0,14
		Summe Dänemark	1.948.079	2,80			Summe Deutschland	950.454	1,38
FINNLAND					GUERNSEY - KANALINSELN				
EUR	100.000	Sampo OYJ 1.50% 16/09/2021	106.279	0,15	EUR	100.000	Credit Suisse Group Funding Guernsey Limited 1.25% 14/04/2022	100.235	0,14
		Summe Finnland	106.279	0,15			Summe Guernsey - Kanalinseln	100.235	0,14

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

			Marktwert	% des Netto- vermögens				Marktwert	% des Netto- vermögens
Nennwert	Anlage		EUR		Nennwert	Anlage		EUR	
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Anleihen (Fortsetzung)				
ISLAND					LUXEMBURG				
EUR	212.000	Arion Banki hf 2.50% 26/04/2019	219.685	0,32	EUR	100.000	Altice SA 7.25% 15/05/2022	105.680	0,15
EUR	162.000	Arion Banki Hf 3.13% 12/03/2018	167.479	0,24	EUR	100.000	Cerberus Nightingale 1 sarl 8.25% 01/02/2020	103.167	0,15
	Summe Island		387.164	0,56	EUR	100.000	Cirsa Funding Lux 5.75% 15/05/2021	105.415	0,15
IRLAND					EUR	100.000	Dufry Finance SCA 4.50% 01/08/2023	105.520	0,15
EUR	100.000	Allied Irish Banks FRN 26/11/2025	96.651	0,14	EUR	125.000	Fiat Finance & Trade SA 4.75% 22/03/2021	136.755	0,20
EUR	125.000	Ardagh Packaging Finance plc 4.25% 15/01/2022	128.018	0,18	EUR	200.000	Gelf Bond Issuer I SA 3.13% 03/04/2018	209.070	0,30
EUR	200.000	Bank of Ireland FRN 29/12/2049	191.554	0,28	EUR	500.000	Grand City Properties SA 2.00% 29/10/2021	537.270	0,77
EUR	325.000	FCA Capital Ireland plc 1.38% 17/04/2020	334.485	0,48	EUR	100.000	Play Topco SA 7.75% 28/02/2020	102.217	0,15
EUR	200.000	FGA Capital Ireland plc 2.88% 26/01/2018	207.375	0,30		Summe Luxemburg	1.405.094	2,02	
EUR	100.000	FGA Capital Ireland plc 4.00% 17/10/2018	107.802	0,16	MEXIKO				
EUR	300.000	Transmission Finance 1.50% 24/05/2023	315.825	0,46	EUR	100.000	Petroleos Mexicanos 1.88% 21/04/2022	96.375	0,14
	Summe Irland		1.381.710	2,00		Summe Mexiko	96.375	0,14	
ITALIEN					NIEDERLANDE				
GBP	41.000	Acquedotto Pugliese SpA 6.92% 29/06/2018	50.894	0,07	EUR	350.000	Deutsche Telekom International Finance BV 0.06% 03/04/2020	350.708	0,51
EUR	100.000	Assicurazioni Generali SpA 2.88% 14/01/2020	109.046	0,16	EUR	204.000	Eneco Holding NV FRN 29/12/2049	210.632	0,30
EUR	140.000	Assicurazioni Generali SpA FRN 27/10/2047	145.783	0,21	EUR	186.000	Enexis Holding NV 1.50% 20/10/2023	202.906	0,29
EUR	1.200.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3.50% 20/03/2017	1.217.693	1,77	EUR	285.000	Evonik Finance BV 0.38% 07/09/2024	283.099	0,41
EUR	100.000	Enel SpA FRN 15/01/2075	106.663	0,15	EUR	200.000	Iberdrola International BV 0.38% 15/09/2025	198.045	0,29
GBP	150.000	Telecom Italia SpA 7.38% 15/12/2017	184.978	0,27	EUR	100.000	ING Bank NV 3.25% 03/04/2019	108.361	0,16
	Summe Italien		1.815.057	2,63	GBP	108.000	ING Bank NV FRN 29/05/2023	133.936	0,19
JERSEY - KANALINSELN					EUR	200.000	Jab Holdings BV 1.75% 25/05/2023	214.053	0,31
EUR	200.000	Heathrow Funding Limited 1.88% 23/05/2024	217.835	0,31	EUR	100.000	Madrikena Red de Gas Finance BV 3.78% 11/09/2018	107.266	0,15
EUR	100.000	Mercury Bondco 8.25% 30/05/2021	104.172	0,15	GBP	150.000	Rwe Finance BV 5.63% 06/12/2023	216.871	0,31
GBP	175.000	UBM plc 6.50% 23/11/2016	203.721	0,30	EUR	75.000	Schaeffler Holding Finance BV 5.75% 15/11/2021	81.902	0,12
	Summe Jersey - Kanalinseln		525.728	0,76	EUR	395.000	SNS Bank NV FRN 05/11/2025	403.207	0,58
					EUR	100.000	Telefonica Europe 3.75% 15/09/2026	99.681	0,14
					EUR	100.000	Telefonica Europe BV FRN 31/03/2049	104.362	0,15

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Anleihen (Fortsetzung)				
NIEDERLANDE (Fortsetzung)					SCHWEDEN				
EUR	200.000	Tennet Holding BV 2.13% 01/11/2020	218.030	0,31	EUR	100.000	Nordea Bank AB 1.38% 12/04/2018	102.277	0,15
EUR	55.000	TenneT Holding BV 6.66% 29/06/2049	57.234	0,08	EUR	700.000	Stadshypotek AB 0.63% 10/11/2021	730.229	1,05
EUR	175.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.25% 31/03/2023	180.926	0,26	Summe Schweden		832.506	1,20	
EUR	245.000	Vesteda Finance BV 1.75% 22/07/2019	254.326	0,37	SCHWEIZ				
EUR	200.000	Vonovia Finance BV FRN 29/12/2049	212.313	0,31	EUR	65.000	Credit Suisse 3.88% 25/01/2017	65.802	0,09
EUR	100.000	Vonovia Finance BV FRN 08/04/2074	106.045	0,15	EUR	780.000	Credit Suisse AG 0.75% 17/09/2021	812.970	1,18
EUR	650.000	Vonovia SE 0.88% 30/03/2020	667.177	0,96	EUR	123.000	Credit Suisse AG 1.50% 10/04/2026	129.816	0,19
Summe Niederlande			4.411.080	6,35	EUR	100.000	Swisscom AG via Lunar Funding 1.88% 08/09/2021	108.982	0,16
					EUR	100.000	UBS AG FRN 12/02/2026	106.892	0,15
					Summe Schweiz		1.224.462	1,77	
NORWEGEN					VEREINIGTES KÖNIGREICH				
EUR	100.000	Avinor AS 1.75% 20/03/2021	107.783	0,16	GBP	100.000	Annington Finance 13.00% 15/01/2023	132.543	0,19
EUR	100.000	Sparebank 1 2.13% 27/02/2019	104.874	0,15	EUR	175.000	Babcock International Group 1.75% 06/10/2022	184.993	0,27
Summe Norwegen			212.657	0,31	GBP	200.000	Barclays plc FRN 29/12/2049	226.654	0,33
PORTUGAL					EUR	185.000	BAT International Finance plc 1.00% 23/05/2022	193.180	0,28
EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2019	23.000	0,03	GBP	175.000	Bg Energy Capital plc FRN 30/11/2072	213.659	0,30
EUR	100.000	Galp Gas Natural 1.38% 19/09/2023	99.444	0,14	USD	219.000	BG Energy Capital plc FRN 30/11/2072	204.047	0,29
Summe Portugal			122.444	0,17	GBP	95.000	British Telecommunications plc 8.50% 07/12/2016	111.261	0,16
SÜDKOREA					GBP	100.000	Cognita Financing plc 7.75% 15/08/2021	121.124	0,17
EUR	1.053.000	Export-Import Bank of Korea 2.00% 30/04/2020	1.125.683	1,62	GBP	100.000	Co-operative Group 6.88% 08/07/2020	133.775	0,19
Summe Südkorea			1.125.683	1,62	GBP	150.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	231.502	0,32
RUSSISCHE FÖDERATION					GBP	170.000	G4s plc 7.75% 13/05/2019	225.812	0,33
EUR	100.000	Gazprom (Gaz Capital SA) 3.76% 15/03/2017	101.384	0,15	GBP	111.000	GKN Holdings plc 6.75% 28/10/2019	148.464	0,21
Summe Russische Föderation			101.384	0,15	GBP	150.000	Go-Ahead Group plc 5.38% 29/09/2017	180.661	0,26
SPANIEN					EUR	200.000	Hammerson plc 2.00% 01/07/2022	210.694	0,31
EUR	141.000	Aigues de Barcelona SA 1.94% 15/09/2021	148.529	0,21	GBP	100.000	HSBC Bank plc FRN 20/03/2023	120.664	0,17
EUR	100.000	NH Hotel Group SA 6.88% 15/11/2019	109.459	0,16	EUR	230.000	HSBC Holdings plc 0.88% 06/09/2024	229.362	0,33
EUR	300.000	Telefonica Emisiones SAU 4.69% 11/11/2019	343.141	0,48					
Summe Spanien			601.129	0,85					

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Anleihen (Fortsetzung)				
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					VEREINIGTE STAATEN				
EUR	105.000	HSBC Holdings plc FRN 10/01/2024	110.303	0,16	EUR	500.000	Berkshire Hathaway Inc. 0.75% 16/03/2023	513.237	0,74
GBP	200.000	Imperial Brands Finance 5.50% 22/11/2016	232.581	0,34	EUR	290.000	Celanese US 1.13% 26/09/2023	292.639	0,42
GBP	300.000	Imperial Tobacco Finance plc 6.25% 04/12/2018	385.364	0,55	EUR	190.000	Citigroup Inc. 7.38% 04/09/2019	230.529	0,33
EUR	100.000	Ineos Finance plc 4.00% 01/05/2023	100.615	0,15	EUR	150.000	Digital Euro Finco LLC 2.63% 15/04/2024	159.845	0,23
GBP	100.000	Jerrold Finco plc 9.75% 15/09/2018	121.693	0,18	EUR	50.000	Fiat Finance North America 5.63% 12/06/2017	51.665	0,07
EUR	100.000	Lloyds Bank plc 1.38% 08/09/2022	105.474	0,15	EUR	200.000	HJ Heinz Company 2.00% 30/06/2023	216.941	0,32
GBP	100.000	Moy Park Bondco plc 6.25% 29/05/2021	120.641	0,17	EUR	200.000	JPMorgan Chase & Company 0.63% 25/01/2024	199.536	0,29
GBP	175.000	National Express Group plc 6.25% 13/01/2017	205.192	0,30	EUR	120.000	JPMorgan Chase & Company 1.38% 16/09/2021	126.923	0,18
EUR	514.000	National Grid Gas 0.63% 22/09/2024	518.598	0,75	EUR	300.000	Kinder Morgan Inc. 2.25% 16/03/2027	303.509	0,44
GBP	125.000	Nationwide Building Society FRN 27/04/2018	144.628	0,21	EUR	150.000	Liberty Mutual Group 2.75% 04/05/2026	162.137	0,23
EUR	100.000	Ngg Finance plc FRN 18/06/2076	107.875	0,16	EUR	290.000	Molson Coors Brewing Company 1.25% 15/07/2024	299.070	0,43
GBP	410.000	Northern Ireland Electricity Limited 6.88% 18/09/2018	525.329	0,77	CHF	150.000	Nord Anglia Education Finance LLC 5.75% 15/07/2022	144.573	0,21
GBP	300.000	Pennon Group plc FRN 08/03/2049	363.519	0,52	Summe Vereinigte Staaten			2.700.604	3,89
EUR	50.000	Royal Bank of Scotland 10.50% 16/03/2022	52.231	0,08	Summe Anleihen			35.520.910	51,22
EUR	170.000	Royal Bank of Scotland Group plc 2.50% 22/03/2023	172.563	0,25	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
GBP	200.000	Royal Bank of Scotland Group plc 6.63% 17/09/2018	255.439	0,37	FRANKREICH				
GBP	150.000	Safeway Limited 6.00% 10/01/2017	175.519	0,25	EUR	1.000.000	France (Govt of) OAT 3.00% 25/04/2022	1.191.765	1,72
GBP	170.000	Telereal 4.09% 10/12/2033	205.899	0,30	Summe Frankreich			1.191.765	1,72
EUR	227.000	Tesco Corporate Tsy Services plc 1.38% 01/07/2019	229.670	0,33	DEUTSCHLAND				
GBP	200.000	Tsb Banking Group plc 5.75% 06/05/2026	244.210	0,35	EUR	2.500.000	Germany (Govt of) 1.92% 15/04/2020	3.041.346	4,39
GBP	100.000	Twinkle Pizza plc 6.63% 01/08/2021	113.480	0,16	Summe Deutschland			3.041.346	4,39
EUR	125.000	Virgin Media Finance plc 4.50% 15/01/2025	124.286	0,18	UNGARN				
GBP	245.000	Virgin Money Holdings 2.25% 21/04/2020	287.662	0,41	EUR	1.250.000	Hungary (Govt of) 3.88% 24/02/2020	1.405.781	2,03
EUR	200.000	Vodafone Group plc 1.25% 25/08/2021	209.864	0,30	HUF	720.330.000	Hungary (Govt of) 5.50% 24/06/2025	2.835.873	4,09
EUR	133.000	WelCome Trust Limited 1.13% 21/01/2027	142.329	0,21	Summe Ungarn			4.241.654	6,12
Summe Vereinigtes Königreich			8.123.359	11,71					

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 USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				
INDONESIEN					SUPRANATIONAL				
EUR	850.000	Indonesia (Govt of) 2.88% 08/07/2021	910.180	1,31	EUR	780.000	Corporacion Andina de Fomento 4.63% 29/03/2018	835.821	1,21
	Summe Indonesien		910.180	1,31		Summe Supranational		835.821	1,21
IRLAND					Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
EUR	260.000	Ireland (Govt of) 3.40% 18/03/2024	324.734	0,47				27.051.370	39,02
	Summe Irland		324.734	0,47	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				
								62.572.280	90,24
ITALIEN					Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt				
EUR	2.237.000	Italy (Govt of) BPT 2.70% 01/03/2047	2.468.865	3,56	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
	Summe Italien		2.468.865	3,56	RUSSISCHE FÖDERATION				
MEXIKO					RUB	383.728.000	Russia (Govt of) 7.50% 18/08/2021	5.265.480	7,59
	Summe Mexiko		1.174.278	1,69		Summe Russische Föderation		5.265.480	7,59
NIEDERLANDE					Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
GBP	675.000	Bank Nederlandse Gemeenten 1.88% 07/12/2018	803.222	1,16	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt				
	Summe Niederlande		803.222	1,16				5.265.480	7,59
PORTUGAL					Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				
EUR	3.267.000	Portugal (Govt of) OT 3.88% 15/02/2030	3.290.359	4,75	Anleihen				
	Summe Portugal		3.290.359	4,75	VEREINIGTE STAATEN				
SÜDKOREA					USD	260.000	Lafargeholcim Finance US 3.50% 22/09/2026	236.395	0,34
EUR	890.000	Export-Import Bank of Korea 4.63% 20/02/2017	905.709	1,31		Summe Vereinigte Staaten		236.395	0,34
	Summe Südkorea		905.709	1,31	Summe Anleihen				
SPANIEN								236.395	0,34
EUR	2.700.000	Spain (Govt of) 0.75% 30/07/2021	2.792.678	4,03	Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				
EUR	3.529.000	Spain (Govt of) 5.85% 31/01/2022	4.604.109	6,63				236.395	0,34
EUR	425.000	Spain (Govt of) BOE 1.95% 30/04/2026	466.650	0,67	Wert der Anlagen insgesamt				
	Summe Spanien		7.863.437	11,33				68.074.155	98,17
					(Gesamtkosten: EUR 68.463.411)				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen					Anleihen (Fortsetzung)				
ARGENTINIEN					GEORGIEN				
USD	500.000	Ypf SA 8.50% 28/07/2025	549.673	1,29	USD	1.185.000	Georgian Railway JSC 7.75% 11/07/2022	1.339.731	3,14
Summe Argentinien			549.673	1,29	Summe Georgien			1.339.731	3,14
BARBADOS					INDIEN				
USD	1.000.000	Columbus International Inc. 7.38% 30/03/2021	1.058.250	2,48	USD	680.000	Adani Port & Special Economic Zone Limited 3.50% 29/07/2020	690.200	1,61
Summe Barbados			1.058.250	2,48	USD	490.000	Oil India Limited 3.88% 17/04/2019	509.654	1,19
BERMUDAS					Summe Indien				
USD	270.000	Digicel Group Limited 7.13% 01/04/2022	209.085	0,49				1.199.854	2,80
USD	325.000	Digicel Group Limited 8.25% 30/09/2020	281.691	0,66	INDONESIEN				
USD	650.000	Kosmos Energy Limited 7.88% 01/08/2021	630.204	1,47	USD	580.000	Pertamina Persero PT 4.30% 20/05/2023	609.745	1,43
Summe Bermudas			1.120.980	2,62	USD	600.000	Pertamina Persero PT 6.00% 03/05/2042	663.129	1,55
KAIMANINSELN					USD	600.000	Pertamina Persero PT 6.50% 27/05/2041	704.898	1,65
USD	420.000	361 Degrees International Ltd 7.25% 03/06/2021	452.183	1,06	Summe Indonesien			1.977.772	4,63
USD	400.000	Baidu Inc. 3.50% 28/11/2022	420.700	0,98	IRLAND				
USD	1.213.000	Comcel Trust 6.88% 06/02/2024	1.245.193	2,91	USD	780.000	Gazpromneft JSC 6.00% 27/11/2023	842.938	1,97
USD	500.000	Grupo Aval Limited 4.75% 26/09/2022	495.995	1,16	USD	250.000	Tinkoff Credit Systems via TCS Finance Limited 14.00% 06/06/2018	279.593	0,65
USD	469.000	Marfrig Overseas Limited 9.50% 04/05/2020	485.713	1,14	Summe Irland			1.122.531	2,62
USD	865.000	Vale Overseas 6.25% 10/08/2026	904.591	2,12	LUXEMBURG				
USD	600.000	Yestar International Holding Company Limited 6.90% 14/09/2046	621.912	1,45	USD	1.140.000	MHP SA 8.25% 02/04/2020	1.100.699	2,57
Summe Kaimaninseln			4.626.287	10,82	USD	450.000	Minerva Luxembourg SA 6.50% 20/09/2026	443.444	1,04
KOLUMBIEN					USD	750.000	Sberbank of Russia via SB Capital SA 6.13% 07/02/2022	828.727	1,95
USD	380.000	Ecopetrol SA 5.88% 18/09/2023	411.213	0,96	USD	500.000	Severstal OAO Via Steel Capital SA 6.70% 25/10/2017	523.833	1,23
Summe Kolumbien			411.213	0,96	Summe Luxemburg			2.896.703	6,79
KROATIEN					MALAYSIA				
USD	200.000	Hrvatska Elektroprivreda 5.88% 23/10/2022	219.923	0,51	USD	760.000	RHB Bank 2.50% 06/10/2021	761.338	1,78
Summe Kroatien			219.923	0,51	Summe Malaysia			761.338	1,78

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Anleihen (Fortsetzung)				
MEXIKO					PERU				
USD	600.000	Cemex SAB de CV 7.25% 15/01/2021	641.637	1,50	USD	500.000	BBVA Banco Continental FRN 22/09/2029	536.503	1,25
USD	476.856	Fermaca Enterprises S de RL de CV 6.38% 30/03/2038	490.697	1,15	USD	321.000	Cementos Pacasmayo 4.50% 08/02/2023	329.754	0,77
USD	737.000	Gruma SAB de CV 4.88% 01/12/2024	794.110	1,85	USD	500.000	Inretail Consumer 5.25% 10/10/2021	521.577	1,22
USD	1.140.000	Grupo Posadas SAB de CV 7.88% 30/06/2022	1.189.373	2,78	USD	850.000	Union Andina de Cementos SAA 5.88% 30/10/2021	886.720	2,07
USD	470.000	JB y Compania SA de CV 3.75% 13/05/2025	481.202	1,13	Summe Peru		2.274.554	5,31	
USD	280.000	Mexico City's Airport Trust 4.25% 31/10/2026	281.732	0,66	RUSSISCHE FÖDERATION				
USD	430.000	Mexico City's Airport Trust 5.50% 31/10/2046	423.346	0,99	USD	200.000	Eurochem M&C OJSC 5.13% 12/12/2017	206.779	0,48
Summe Mexiko			4.302.097	10,06	Summe Russische Föderation		206.779	0,48	
MAROKKO					SINGAPUR				
USD	745.000	OCP SA 6.88% 25/04/2044	845.545	1,98	USD	620.000	Golden Legacy Pte Limited 8.25% 07/06/2021	664.665	1,55
Summe Marokko			845.545	1,98	USD	435.000	United Overseas Bank Limited 2.88% 08/03/2027	434.737	1,02
NIEDERLANDE					Summe Singapur				
USD	630.000	Bharti Airtel International Netherlands BV 5.35% 20/05/2024	692.433	1,62	THAILAND				
USD	450.000	Greenko Dutch BV 8.00% 01/08/2019	482.281	1,13	USD	880.000	Kasikornbank pcl 2.38% 06/04/2022	878.587	2,05
USD	275.000	Gth Finance BV 7.25% 26/04/2023	299.072	0,70	USD	433.000	Krung Thai Bank pcl FRN 26/12/2024	457.029	1,07
USD	440.000	Kazmunaygas National Company JSC 9.13% 02/07/2018	486.677	1,14	Summe Thailand		1.335.616	3,12	
USD	210.000	Listrindo Capital BV 4.95% 14/09/2026	211.019	0,49	TÜRKEI				
USD	1.200.000	Petrobras 8.75% 23/05/2026	1.328.598	3,11	USD	500.000	Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği AS 5.88% 12/08/2020	528.800	1,24
USD	800.000	Petrobras Global Finance BV 4.88% 17/03/2020	807.016	1,89	Summe Türkei		528.800	1,24	
USD	419.000	Petrobras Global Finance BV 8.38% 23/05/2021	458.484	1,07	VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				
USD	500.000	Royal Bank of Scotland FRN 29/12/2049	522.155	1,22	USD	530.000	DP World Limited 6.85% 02/07/2037	615.603	1,44
USD	200.000	Royal Capital BV FRN 29/05/2049	210.745	0,49	Summe Vereinigte Arabische Emirate		615.603	1,44	
Summe Niederlande			5.498.480	12,86					

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				
VEREINIGTE STAATEN					IRLAND				
USD	500.000	Alfa Bank Ojsc Via Alfa Bond Issuance plc 7.50% 26/09/2019	547.929	1,28	USD	450.000	VEB Finance Limited 6.90% 09/07/2020	490.601	1,15
USD	600.000	Reliance Holdings Inc. 5.40% 14/02/2022	676.545	1,58	Summe Irland		490.601	1,15	
		Summe Vereinigte Staaten	1.224.474	2,86					
BRITISCHE JUNGFERNINSELN					SÜDAFRIKA				
USD	385.000	Star Energy Geothermal 6.13% 27/03/2020	403.214	0,95	USD	607.000	Eskom Holdings Limited 5.75% 26/01/2021	608.041	1,42
		Summe Britische Jungferninseln	403.214	0,95	Summe Südafrika		608.041	1,42	
		Summe Anleihen	35.618.819	83,31					
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente					SRI LANKA				
					USD	295.000	Sri Lanka (Govt of) 5.75% 18/01/2022	302.325	0,71
					USD	400.000	Sri Lanka (Govt of) 6.25% 27/07/2021	419.238	0,98
					Summe Sri Lanka		721.563	1,69	
ARGENTINIEN					Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
USD	355.000	Cordoba (Province of) 7.13% 10/06/2021	373.476	0,87			5.039.276	11,79	
USD	540.000	Cordoba (Province of) 12.38% 17/08/2017	582.309	1,37					
USD	150.000	Provincia de Buenos Aires 9.13% 16/03/2024	168.314	0,39	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind		40.658.095	95,10	
		Summe Argentinien	1.124.099	2,63	Wert der Anlagen insgesamt		40.658.095	95,10	
					(Gesamtkosten: USD 38.661.795)				
KROATIEN									
USD	378.000	Croatia (Govt of) 6.75% 05/11/2019	419.693	0,98					
		Summe Kroatien	419.693	0,98					
DOMINIKANISCHE REPUBLIK									
USD	440.000	Dominican Republic (Govt of) 7.45% 30/04/2044	525.807	1,23					
		Summe Dominikanische Republik	525.807	1,23					
ECUADOR									
USD	670.000	Ecuador (Govt of) 10.75% 28/03/2022	686.546	1,61					
		Summe Ecuador	686.546	1,61					
GHANA									
USD	450.000	Ghana (Govt of) 9.25% 15/09/2022	462.926	1,08					
		Summe Ghana	462.926	1,08					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen					Anleihen (Fortsetzung)				
KOLUMBIEN					LUXEMBURG				
USD	770.000	Ecopetrol SA 5.38% 26/06/2026	801.701	0,80	USD	374.000	Gaz Capital for Gazprom OAO 6.51% 07/03/2022	417.889	0,42
USD	825.000	Ecopetrol SA 5.88% 28/05/2045	760.233	0,76					
COP	2.897.000.000	Empresas Publicas de Medellin 7.63% 10/09/2024	945.933	0,95	USD	665.000	Gazprom via Gaz Capital SA 7.29% 16/08/2037	784.005	0,78
Summe Kolumbien			2.507.867	2,51	Summe Luxemburg			1.201.894	1,20
KROATIEN					MEXIKO				
USD	118.000	Hrvatska Elektroprivreda 5.88% 23/10/2022	129.755	0,13	USD	490.000	Bancomex 3.80% 11/08/2026	478.681	0,48
Summe Kroatien			129.755	0,13	USD	593.000	Comision Federal de Electricidad 4.88% 26/05/2021	626.549	0,62
GEORGIEN					USD	650.000	Mexico City's Airport Trust 4.25% 31/10/2026	654.020	0,66
USD	619.000	Georgian Railway JSC 7.75% 11/07/2022	699.826	0,70	USD	1.004.000	Petroleos Mexicanos 3.50% 30/01/2023	951.842	0,95
Summe Georgien			699.826	0,70	USD	420.000	Petroleos Mexicanos 4.63% 21/09/2023	422.640	0,42
UNGARN					USD	601.000	Petroleos Mexicanos 4.88% 24/01/2022	614.631	0,61
USD	733.000	Magyar Export-Import Bank Zrt 4.00% 30/01/2020	765.549	0,76	USD	1.056.000	Petroleos Mexicanos 4.88% 18/01/2024	1.071.449	1,07
Summe Ungarn			765.549	0,76	USD	532.000	Petroleos Mexicanos 5.50% 21/01/2021	566.245	0,56
INDONESIEN					USD	459.000	Petroleos Mexicanos 5.50% 27/06/2044	398.529	0,40
USD	768.000	Pertamina PT 5.25% 23/05/2021	839.485	0,84	USD	937.000	Petroleos Mexicanos 6.38% 23/01/2045	899.244	0,90
USD	798.000	Perusahaan Listrik Negara Pt 5.25% 24/10/2042	823.193	0,82	USD	688.000	Petroleos Mexicanos 6.50% 02/06/2041	674.099	0,67
USD	731.000	Perusahaan Penerbit Sbsn Indonesia 4.00% 21/11/2018	764.012	0,76	USD	570.000	Petroleos Mexicanos 6.75% 21/09/2047	570.464	0,57
Summe Indonesien			2.426.690	2,42	Summe Mexiko			7.928.393	7,91
IRLAND					MONGOLEI				
USD	299.000	Russian Railways via Rzd Capital plc 5.70% 05/04/2022	326.136	0,33	USD	206.000	Trade & Development Bank of Mongolia LLC 9.38% 19/05/2020	204.256	0,20
USD	657.000	Vnesheconombank via Veb Finance Limited 6.80% 22/11/2025	726.133	0,73	Summe Mongolei			204.256	0,20
USD	350.000	Vnesheconombank Via Veb Finance plc 5.94% 21/11/2023	370.766	0,37	NIEDERLANDE				
Summe Irland			1.423.035	1,43	USD	1.236.000	Kazakhstan Temir Zholy Finance BV 6.95% 10/07/2042	1.343.458	1,33
KASACHSTAN					USD	304.000	Majapahit Holding BV 7.25% 28/06/2017	315.739	0,31
USD	438.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 4.13% 10/12/2022	430.843	0,43	USD	1.373.000	Petrobras Global Finance BV 6.25% 17/03/2024	1.340.885	1,33
USD	670.000	Kazagro National Management Holding JSC 4.63% 24/05/2023	647.458	0,65	USD	1.696.000	Petrobras International Finance Company 5.38% 27/01/2021	1.681.642	1,67
Summe Kasachstan			1.078.301	1,08	Summe Niederlande			4.681.724	4,64

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
PERU					ANGOLA				
USD	200.000	Corporacion Financiera de Desarrollo SA 5.25% 15/07/2029	214.988	0,21	USD	510.000	Angola (Govt of) 9.50% 12/11/2025	509.403	0,51
		Summe Peru	214.988	0,21			Summe Angola	509.403	0,51
RUSSISCHE FÖDERATION					ARGENTINIEN				
USD	670.000	Gazprom Neft DAO via Gpn Capital SA 4.38% 19/09/2022	675.226	0,67	USD	500.000	Argentina (Govt of) 6.63% 06/07/2028	530.085	0,53
		Summe Russische Föderation	675.226	0,67	USD	470.000	Argentina (Govt of) 6.88% 22/04/2021	512.180	0,51
TRINIDAD & TOBAGO					USD	936.000	Argentina (Govt of) 7.13% 06/07/2036	992.979	0,99
USD	937.000	Petroleum Company of Trinidad & Tobago Limited 9.75% 14/08/2019	1.039.883	1,04	USD	250.000	Argentina (Govt of) 7.50% 22/04/2026	282.359	0,28
		Summe Trinidad & Tobago	1.039.883	1,04	USD	500.000	Argentina (Govt of) 7.63% 22/04/2046	564.780	0,56
TUNESIEN					USD	845.591	Argentina (Govt of) 8.75% 07/05/2024	985.429	0,98
USD	695.000	Banque Centrale de Tunisie SA 5.75% 30/01/2025	682.542	0,68	USD	577.038	Argentina Bonar Bonds 8.00% 08/10/2020	656.890	0,65
		Summe Tunesien	682.542	0,68	USD	619.000	Buenos Aires (ProvIncia de) 9.95% 09/06/2021	711.714	0,71
VEREINIGTE STAATEN					USD	905.000	Cordoba (Province of) 7.13% 10/06/2021	952.101	0,95
USD	688.000	Pemex Project Funding Master Trust 6.63% 15/06/2035	699.063	0,70	USD	380.000	Provincia de Buenos Aires 9.13% 16/03/2024	426.396	0,42
		Summe Vereinigte Staaten	699.063	0,70			Summe Argentinien	6.614.913	6,58
VENEZUELA					BRASILIEN				
USD	946.402	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 16/05/2024	405.543	0,40	USD	731.000	Brazil (Govt of) 4.25% 07/01/2025	731.512	0,73
USD	1.314.124	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	554.298	0,55	USD	828.000	Brazil (Govt of) 4.88% 22/01/2021	884.201	0,88
USD	1.390.549	Petroleos de Venezuela SA 9.00% 17/11/2021	785.167	0,78	USD	879.000	Brazil (Govt of) 5.63% 07/01/2041	872.957	0,87
USD	558.551	Petroleos de Venezuela SA 9.75% 17/05/2035	289.167	0,29	USD	414.000	Brazil (Govt of) 7.13% 20/01/2037	485.901	0,48
		Summe Venezuela	2.034.175	2,02	USD	338.000	Brazil (Govt of) 8.25% 20/01/2034	435.065	0,43
		Summe Anleihen	28.393.167	28,30			Summe Brasilien	3.409.636	3,39
Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen					KOLUMBIEN				
					COP	2.142.000.000	Colombia (Govt of) 9.85% 28/06/2027	906.322	0,90
							Summe Kolumbien	906.322	0,90
PANAMA									
USD	630.000	Autoridad del Canal de Panama 4.95% 29/07/2035	718.200	0,72					
		Summe Panama	718.200	0,72					
Summe Forderungs- und hypothekenbesicherte Wertpapiere									
			718.200	0,72					

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				
COSTA RICA					EL SALVADOR				
USD	435.000	Costa Rica (Govt of) 4.25% 26/01/2023	429.410	0,43	USD	338.000	El Salvador (Govt of) 5.88% 30/01/2025	338.091	0,34
USD	550.000	Costa Rica (Govt of) 4.38% 30/04/2025	535.444	0,53	USD	233.000	El Salvador (Govt of) 7.65% 15/06/2035	245.582	0,24
USD	802.000	Costa Rica Government 7.16% 12/03/2045	865.691	0,86	USD	474.000	El Salvador (Govt of) 8.25% 10/04/2032	529.688	0,53
Summe Costa Rica			1.830.545	1,82	Summe El Salvador			1.113.361	1,11
KROATIEN					ÄTHIOPIEN				
USD	803.000	Croatia (Govt of) 6.00% 26/01/2024	924.349	0,92	USD	367.000	Ethiopia (Govt of) 6.63% 11/12/2024	364.057	0,36
USD	619.000	Croatia (Govt of) 6.75% 05/11/2019	687.276	0,68	Summe Äthiopien			364.057	0,36
Summe Kroatien			1.611.625	1,60					
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					GABUN				
USD	604.000	Dominican (Govt of) 5.88% 18/04/2024	653.271	0,65	USD	876.377	Gabon (Govt of) 6.38% 12/12/2024	804.606	0,80
USD	1.727.000	Dominican (Govt of) 7.50% 06/05/2021	1.935.571	1,94	USD	230.000	Gabon (Govt of) 6.95% 16/06/2025	212.352	0,21
USD	500.000	Dominican Republic (Govt of) 6.85% 29/01/2026	580.193	0,58	Summe Gabun			1.016.958	1,01
USD	780.000	Dominican Republic (Govt of) 7.45% 30/04/2044	932.112	0,93	GEORGIEN				
USD	355.000	Dominican Republic (Govt of) 6.85% 27/01/2045	399.061	0,40	USD	626.000	Georgia (Govt of) 6.88% 12/04/2021	701.690	0,70
Summe Dominikanische Republik			4.500.208	4,50	Summe Georgien			701.690	0,70
GHANA									
USD	528.332	Ghana (Govt of) 7.88% 07/08/2023			USD	528.332	Ghana (Govt of) 7.88% 07/08/2023	495.676	0,49
USD	1.082.000	Ghana (Govt of) 8.13% 18/01/2026			USD	1.082.000	Ghana (Govt of) 8.13% 18/01/2026	1.011.329	1,01
USD	270.000	Ecuador (Govt of) 10.50% 24/03/2020	276.431	0,28	USD	660.000	Ghana (Govt of) 9.25% 15/09/2022	678.959	0,68
USD	1.050.000	Ecuador (Govt of) 10.75% 28/03/2022	1.075.929	1,06	Summe Ghana			2.185.964	2,18
Summe Ecuador			1.938.244	1,92	GUATEMALA				
ÄGYPTEN					USD	245.000	Guatemala (Govt of) 4.50% 03/05/2026	255.873	0,26
USD	1.100.000	Egypt (Govt of) 5.88% 11/06/2025	1.051.078	1,05	USD	1.048.000	Guatemala (Govt of) 4.88% 13/02/2028	1.140.214	1,15
Summe Ägypten			1.051.078	1,05	USD	632.000	Guatemala (Govt of) 5.75% 06/06/2022	711.041	0,71
					Summe Guatemala			2.107.128	2,12

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				
UNGARN					JAMAICA				
USD	344.000	Hungary (Govt of) 5.38% 21/02/2023	394.886	0,39	USD	590.000	Jamaica (Govt of) 6.75% 28/04/2028	677.140	0,67
USD	370.000	Mfb Magyar Fejlesztési Bank Zrt 6.25% 21/10/2020	419.552	0,42	USD	200.000	Jamaica (Govt of) 8.00% 15/03/2039	238.969	0,24
Summe Ungarn			814.438	0,81	Summe Jamaica			916.109	0,91
INDONESIEN					MEXIKO				
USD	478.000	Indonesia (Govt of) 3.38% 15/04/2023	494.415	0,49	USD	552.000	Mexico (Govt of) 3.63% 15/03/2022	584.071	0,58
USD	811.000	Indonesia (Govt of) 3.75% 25/04/2022	855.451	0,85	USD	980.000	Mexico (Govt of) 4.60% 23/01/2046	1.003.363	1,00
USD	693.000	Indonesia (Govt of) 4.63% 15/04/2043	741.843	0,74	USD	767.000	Mexico (Govt of) 6.75% 27/09/2034	1.025.383	1,02
USD	834.000	Indonesia (Govt of) 5.25% 17/01/2042	956.143	0,95	MXN	295.000	Mexico (Govt of) Bonos 7.75% 23/11/2034	1.730.132	1,73
USD	586.000	Indonesia (Govt of) 5.88% 13/03/2020	655.854	0,65	MXN	15.122	Mexico (Govt of) Udibonos 4.00% 15/11/2040	483.201	0,48
USD	612.000	Indonesia (Govt of) 5.88% 15/01/2024	722.897	0,72	Summe Mexiko			4.826.150	4,81
USD	525.000	Indonesia (Govt of) 6.63% 17/02/2037	688.438	0,69	NAMIBIA				
USD	509.000	Indonesia (Govt of) 6.75% 15/01/2044	697.913	0,70	USD	885.000	Namibia (Govt of) 5.50% 03/11/2021	955.592	0,95
USD	278.000	Indonesia (Govt of) 7.75% 17/01/2038	402.456	0,40	Summe Namibia			955.592	0,95
IDR	9.000.000.000	Indonesia (Govt of) 8.38% 15/09/2026	755.500	0,75	PAKISTAN				
USD	253.000	Indonesia (Govt of) 8.50% 12/10/2035	383.538	0,38	USD	388.000	Pakistan (Govt of) 6.75% 03/12/2019	409.472	0,41
Summe Indonesien			7.354.448	7,32	USD	790.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 15/04/2024	868.609	0,87
					Summe Pakistan			1.278.081	1,28
IRLAND					PANAMA				
USD	913.000	VEB Finance Limited 6.90% 09/07/2020	995.375	0,99	USD	440.000	Panama (Govt of) 4.00% 22/09/2024	483.065	0,48
Summe Irland			995.375	0,99	Summe Panama			483.065	0,48
ELFENBEINKÜSTE					PARAGUAY				
USD	1.209.000	Ivory Coast (Govt of) 5.38% 23/07/2024	1.218.055	1,22	USD	620.000	Paraguay (Govt of) 6.10% 11/08/2044	704.407	0,70
USD	986.040	Ivory Coast (Govt of) FRN 31/12/2032	973.877	0,97	Summe Paraguay			704.407	0,70
Summe Elfenbeinküste			2.191.932	2,19					
					PERU				
					USD	914.000	Peru (Govt of) 7.35% 21/07/2025	1.275.990	1,28
					Summe Peru			1.275.990	1,28

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)			
PHILIPPINEN				TÜRKEI			
USD	367.000 Philippine (Govt of) 5.00% 13/01/2037	473.718	0,47	USD	252.000 Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS 4.56% 10/10/2018	259.317	0,26
USD	430.000 Philippine (Govt of) 6.38% 15/01/2032	608.783	0,61	USD	488.000 Turkey (Govt of) 5.13% 25/03/2022	509.765	0,51
USD	144.000 Philippine (Govt of) 7.75% 14/01/2031	224.788	0,22	USD	598.000 Turkey (Govt of) 5.63% 30/03/2021	638.431	0,64
USD	276.000 Philippine (Govt of) 8.38% 17/06/2019	326.442	0,33	USD	390.000 Turkey (Govt of) 5.75% 22/03/2024	421.309	0,42
	Summe Philippinen	1.633.731	1,63	USD	530.000 Turkey (Govt of) 6.25% 26/09/2022	583.912	0,58
RUMÄNIEN				USD	204.000 Turkey (Govt of) 6.63% 17/02/2045	238.913	0,24
USD	182.000 Romania (Govt of) 4.38% 22/08/2023	201.683	0,20	USD	500.000 Turkey (Govt of) 6.75% 30/05/2040	585.180	0,58
	Summe Rumänien	201.683	0,20	USD	585.000 Turkey (Govt of) 6.88% 17/03/2036	686.878	0,68
RUSSISCHE FÖDERATION				USD	619.000 Turkey (Govt of) 7.38% 05/02/2025	735.202	0,73
USD	600.000 Russia (Govt of) 4.88% 16/09/2023	660.480	0,66	USD	443.000 Turkey (Govt of) 7.50% 07/11/2019	495.053	0,49
USD	500.000 Russia (Govt of) 5.00% 29/04/2020	540.045	0,54	USD	297.000 Turkey (Govt of) 8.00% 14/02/2034	385.632	0,38
USD	200.000 Russia (Govt of) 5.63% 04/04/2042	231.671	0,23		Summe Türkei	5.539.592	5,51
USD	423.889 Russia (Govt of) 7.50% 31/03/2030	514.919	0,51	URUGUAY			
	Summe Russische Föderation	1.947.115	1,94	USD	321.663 Uruguay (Govt of) 4.38% 27/10/2027	346.600	0,35
SENEGAL				USD	126.889 Uruguay (Govt of) 4.50% 14/08/2024	140.219	0,14
USD	590.000 Senegal (Govt of) 6.25% 30/07/2024	611.998	0,61	USD	129.413 Uruguay (Govt of) 6.88% 28/09/2025	163.222	0,16
	Summe Senegal	611.998	0,61		Summe Uruguay	650.041	0,65
SERBIEN				VENEZUELA			
USD	268.000 Serbia (Govt of) 4.88% 25/02/2020	280.631	0,28	USD	1.000.000 Venezuela (Govt of) 7.65% 21/04/2025	482.500	0,48
USD	547.000 Serbia (Govt of) 5.88% 03/12/2018	580.673	0,58	USD	2.178.000 Venezuela (Govt of) 7.75% 13/10/2019	1.355.478	1,36
	Summe Serbien	861.304	0,86	USD	1.164.800 Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024	577.158	0,58
				USD	566.700 Venezuela (Govt of) 9.00% 07/05/2023	290.448	0,29
					Summe Venezuela	2.705.584	2,71

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				
SAMBIA				
USD	346.000	Zambia (Govt of) 5.38% 20/09/2022	305.125	0,30
USD	356.000	Zambia (Govt of) 8.50% 14/04/2024	350.409	0,35
		Summe Sambia	655.534	0,65
		Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente	66.463.301	66,23
		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	95.574.668	95,25

Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt

Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente

PANAMA				
USD	585.000	Panama (Govt of) 5.63% 25/07/2022	670.360	0,67
		Summe Panama	670.360	0,67
		Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente	670.360	0,67
		Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt	670.360	0,67

Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente

DOMINIKANISCHE REPUBLIK				
DOP	37.200.000	Dominican (Govt of) 16.95% 04/02/2022	1.030.311	1,03
		Summe Dominikanische Republik	1.030.311	1,03
		Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente	1.030.311	1,03
		Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	1.030.311	1,03
		Wert der Anlagen insgesamt	97.275.339	96,95
(Gesamtkosten: USD 95.315.440)				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

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

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens		
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)						
Anleihen					Anleihen (Fortsetzung)						
BERMUDAS					UNGARN						
USD	815.000	Kosmos Energy Limited 7.88% 01/08/2021	790.179	1,09	USD	630.000	Magyar Export-Import Bank Zrt 4.00% 30/01/2020	657.975	0,90		
Summe Bermudas			790.179	1,09	Summe Ungarn			657.975	0,90		
KAIMANINSELN					INDIEN						
USD	567.000	Marfrig Overseas Limited 9.50% 04/05/2020	587.205	0,81	USD	277.000	Export-Import Bank of India 2.75% 12/08/2020	281.514	0,39		
USD	980.000	Petrobras International Finance Company 7.88% 15/03/2019	1.065.054	1,46	USD	371.000	Export-Import Bank of India 3.88% 02/10/2019	389.945	0,54		
Summe Kaimaninseln			1.652.259	2,27	Summe Indien			671.459	0,93		
KOLUMBIEN					INDONESIEN						
USD	790.000	Ecopetrol SA 5.88% 18/09/2023	854.891	1,18	USD	700.000	Pertamina PT 4.88% 03/05/2022	756.760	1,04		
Summe Kolumbien			854.891	1,18	USD	1.547.000	Pertamina PT 5.25% 23/05/2021	1.690.994	2,32		
					Summe Indonesien			2.447.754	3,36		
COSTA RICA					IRLAND						
USD	1.600.000	Banco Nacional de Costa Rica 5.88% 25/04/2021	1.674.688	2,30	USD	1.420.000	Gtlk Europe Limited 5.95% 19/07/2021	1.478.362	2,03		
USD	231.000	Instituto Costarricense de Electricidad 6.95% 10/11/2021	246.808	0,34	Summe Irland			1.478.362	2,03		
Summe Costa Rica			1.921.496	2,64							
KROATIEN					KASACHSTAN						
USD	1.215.000	Hrvatska Elektroprivreda 5.88% 23/10/2022	1.336.032	1,84	USD	1.100.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 4.13% 10/12/2022	1.082.026	1,49		
Summe Kroatien			1.336.032	1,84	Summe Kasachstan			1.082.026	1,49		
ZYPERN					LUXEMBURG						
USD	905.000	Global Ports Finance 6.50% 22/09/2023	909.923	1,25	USD	610.000	Minerva Luxembourg SA 6.50% 20/09/2026	601.112	0,83		
Summe Zypern			909.923	1,25	Summe Luxemburg			601.112	0,83		
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					MALAYSIA						
USD	701.000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA 9.75% 13/11/2019	738.044	1,02	USD	1.860.000	RHB Bank 2.50% 06/10/2021	1.863.274	2,56		
Summe Dominikanische Republik			738.044	1,02	Summe Malaysia			1.863.274	2,56		
GEORGIEN											
USD	1.469.000	Georgian Railway JSC 7.75% 11/07/2022	1.660.815	2,29							
Summe Georgien			1.660.815	2,29							

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	
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)					Anleihen (Fortsetzung)					
MEXIKO					THAILAND					
USD	670.000	Bancomext 3.80% 11/08/2026	654.523	0,90	USD	1.500.000	Kasikornbank plc 2.38% 06/04/2022	1.497.593	2,06	
USD	750.000	Grupo Posadas SAB de CV 7.88% 30/06/2022	782.483	1,08	Summe Thailand				1.497.593	2,06
USD	570.000	Mexico City's Airport Trust 4.25% 31/10/2026	573.525	0,79	TÜRKEI					
USD	755.000	Petroleos Mexicanos 3.13% 23/01/2019	762.697	1,05	USD	1.319.000	Export Credit Bank of Turkey 5.88% 24/04/2019	1.375.183	1,89	
USD	1.130.000	Petroleos Mexicanos 5.50% 04/02/2019	1.195.404	1,64	Summe Türkei				1.375.183	1,89
Summe Mexiko			3.968.632	5,46	UKRAINE					
MONGOLEI					USD	1.000.000	Oschadbank 9.38% 10/03/2023	968.870	1,33	
USD	323.000	Trade & Development Bank of Mongolia LLC 9.38% 19/05/2020	320.266	0,44	Summe Ukraine				968.870	1,33
Summe Mongolei			320.266	0,44	VEREINIGTES KÖNIGREICH					
NIEDERLANDE					USD	865.000	Ukreximbank Via Biz Finance plc 9.63% 27/04/2022	849.283	1,17	
USD	1.174.000	Kazmunaygas National Company JSC 9.13% 02/07/2018	1.298.544	1,78	Summe Vereinigtes Königreich				849.283	1,17
USD	610.000	Listrindo Capital BV 4.95% 14/09/2026	612.959	0,84	VENEZUELA					
USD	1.509.000	Majapahit Holding BV 7.75% 20/01/2020	1.739.658	2,39	USD	488.861	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 16/05/2024	209.482	0,29	
USD	568.000	Majapahit Holding BV 8.00% 07/08/2019	652.788	0,90	USD	491.751	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	207.421	0,29	
USD	404.000	Petrobras Global Finance BV 6.25% 17/03/2024	394.550	0,54	USD	1.182.606	Petroleos de Venezuela SA 9.00% 17/11/2021	667.753	0,92	
USD	367.000	Petrobras International Finance Company 5.38% 27/01/2021	363.893	0,50	USD	500.000	Petroleos de Venezuela SA 12.75% 17/02/2022	331.155	0,46	
USD	200.000	Royal Bank of Scotland FRN 29/12/2049	208.862	0,29	Summe Venezuela				1.415.811	1,96
Summe Niederlande			5.271.254	7,24	Summe Anleihen				36.972.929	50,86
PERU					Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente					
USD	1.069.000	Volcan Compania Minera SAA 5.38% 02/02/2022	1.045.830	1,44	ARGENTINIEN					
Summe Peru			1.045.830	1,44	USD	837.097	Buenos Aires (ProvIncia de) 9.95% 09/06/2021	962.477	1,32	
SRI LANKA					USD	1.140.000	Cordoba (Province of) 7.13% 10/06/2021	1.199.331	1,65	
USD	1.477.000	National Savings Bank 8.88% 18/09/2018	1.594.606	2,19	USD	1.300.000	Cordoba (Province of) 12.38% 17/08/2017	1.401.855	1,93	
Summe Sri Lanka			1.594.606	2,19	USD	700.000	Provincia de Buenos Aires 10.88% 26/01/2021	814.772	1,12	
					Summe Argentinien				4.378.435	6,02

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				
BRASILIEN					GHANA				
BRL	6.935	Brazil (Govt of) 10.00% 01/01/2021	2.035.082	2,79	USD	1.042.000	Ghana (Govt of) 7.88% 07/08/2023	977.594	1,34
		Summe Brasilien	2.035.082	2,79	USD	600.000	Ghana (Govt of) 9.25% 15/09/2022	617.235	0,85
							Summe Ghana	1.594.829	2,19
KROATIEN					GUATEMALA				
USD	350.000	Croatia (Govt of) 5.50% 04/04/2023	389.813	0,54	USD	547.000	Guatemala (Govt of) 5.75% 06/06/2022	615.411	0,85
USD	1.200.000	Croatia (Govt of) 6.38% 24/03/2021	1.351.410	1,86			Summe Guatemala	615.411	0,85
USD	600.000	Croatia (Govt of) 6.63% 14/07/2020	673.065	0,93					
USD	840.000	Croatia (Govt of) 6.75% 05/11/2019	932.652	1,28	UNGARN				
		Summe Kroatien	3.346.940	4,61	USD	587.000	Mfb Magyar Fejlesztési Bank Zrt 6.25% 21/10/2020	665.614	0,92
							Summe Ungarn	665.614	0,92
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					IRLAND				
USD	200.000	Dominican (Govt of) 7.50% 06/05/2021	224.154	0,31	USD	2.000.000	VEB Finance Limited 6.90% 09/07/2020	2.180.450	3,00
		Summe Dominikanische Republik	224.154	0,31			Summe Irland	2.180.450	3,00
ECUADOR					ELFENBEINKÜSTE				
USD	800.000	Ecuador (Govt of) 7.95% 20/06/2024	721.088	0,99	USD	345.510	Ivory Coast (Govt of) FRN 31/12/2032	341.248	0,47
USD	1.060.000	Ecuador (Govt of) 10.75% 28/03/2022	1.086.177	1,49			Summe Elfenbeinküste	341.248	0,47
		Summe Ecuador	1.807.265	2,48					
ÄGYPTEN					NIGERIA				
USD	600.000	Egypt (Govt of) 5.75% 29/04/2020	617.979	0,85	USD	899.000	Nigeria (Govt of) 6.75% 28/01/2021	908.606	1,25
		Summe Ägypten	617.979	0,85			Summe Nigeria	908.606	1,25
EL SALVADOR					SENEGAL				
USD	500.000	El Salvador (Govt of) 5.88% 30/01/2025	500.135	0,69	USD	340.000	Senegal (Govt of) 6.25% 30/07/2024	352.677	0,49
USD	881.000	El Salvador (Govt of) 7.38% 01/12/2019	943.044	1,30	USD	904.000	Senegal (Govt of) 8.75% 13/05/2021	1.029.891	1,42
		Summe El Salvador	1.443.179	1,99			Summe Senegal	1.382.568	1,91
GABUN									
USD	350.000	Gabon (Govt of) 6.38% 12/12/2024	321.337	0,44					
		Summe Gabun	321.337	0,44					

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
SERBIEN					DOMINIKANISCHE REPUBLIK				
USD	2.415.000	Serbia (Govt of) 4.88% 25/02/2020	2.528.819	3,47	DOP	25.170.000	Dominican (Govt of) 15.50% 01/06/2018	590.628	0,81
USD	300.000	Serbia (Govt of) 7.25% 28/09/2021	349.920	0,48			Summe Dominikanische Republik	590.628	0,81
Summe Serbien			2.878.739	3,95			Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente	590.628	0,81
SÜDAFRIKA					Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				
USD	600.000	Eskom Holdings Limited 5.75% 26/01/2021	601.029	0,83				590.628	0,81
Summe Südafrika			601.029	0,83			Wert der Anlagen insgesamt (Gesamtkosten: USD 65.320.241)	67.789.100	93,24
SRI LANKA									
USD	593.000	Sri Lanka (Govt of) 5.13% 11/04/2019	601.394	0,83					
USD	200.000	Sri Lanka (Govt of) 6.25% 27/07/2021	209.619	0,29					
Summe Sri Lanka			811.013	1,12					
TÜRKEI									
USD	1.014.000	Export Credit Bank 5.00% 23/09/2021	1.026.305	1,41					
Summe Türkei			1.026.305	1,41					
VENEZUELA									
USD	4.265.000	Venezuela (Govt of) 7.75% 13/10/2019	2.654.322	3,64					
USD	600.000	Venezuela (Govt of) 12.75% 23/08/2022	391.038	0,54					
Summe Venezuela			3.045.360	4,18					
Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente			30.225.543	41,57					
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind			67.198.472	92,43					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond*

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Anleihen				Anleihen (Fortsetzung)			
BERMUDAS				ITALIEN			
USD	673.000 Aircastle Limited 5.50% 15/02/2022	726.991	0,34	USD	489.000 Telecom Italia SpA 5.30% 30/05/2024	500.257	0,23
USD	454.000 Weatherford Bermuda 7.75% 15/06/2021	450.710	0,22	Summe Italien		500.257	0,23
USD	255.000 Weatherford Bermuda 7.75% 15/06/2021	253.153	0,12	LUXEMBURG			
USD	94.000 Weatherford International Limited 8.25% 15/06/2023	93.025	0,04	USD	421.000 Arcelormittal 7.25% 25/02/2022	476.471	0,22
Summe Bermudas		1.523.879	0,72	USD	530.000 Ineos Group Holdings 5.63% 01/08/2024	519.400	0,24
KANADA				USD	342.000 Ineos Group Holdings SA 5.88% 15/02/2019	349.746	0,16
USD	385.000 Teck Resources Limited 6.25% 15/07/2041	366.476	0,17	USD	168.000 Wind Acquisition 7.38% 23/04/2021	176.266	0,08
Summe Kanada		366.476	0,17	USD	677.000 Wind Acquisition Finance SA 4.75% 15/07/2020	686.471	0,32
FRANKREICH				USD	72.000 Wind Acquisition Finance SA 6.50% 30/04/2020	75.577	0,04
USD	2.386.000 Numericable-SFR SA 7.38% 01/05/2026	2.433.816	1,14	Summe Luxemburg		2.283.931	1,06
Summe Frankreich		2.433.816	1,14	NIEDERLANDE			
DEUTSCHLAND				USD	798.000 Cnh Industrial NV 4.50% 15/08/2023	806.144	0,38
USD	225.000 Unitymedia Hessen 5.50% 15/01/2023	234.197	0,11	USD	419.000 Constellium NV 5.75% 15/05/2024	389.670	0,18
USD	789.000 Unitymedia Hessen GmbH 5.00% 15/01/2025	806.886	0,38	USD	480.000 Schaeffler Finance BV 4.25% 15/05/2021	492.489	0,24
USD	616.000 Unitymedia Kabelbw GmbH 6.13% 15/01/2025	651.364	0,30	USD	140.000 Schaeffler Finance BV 4.75% 15/05/2023	145.302	0,07
Summe Deutschland		1.692.447	0,79	USD	420.000 Ziggo Bond Finance BV 6.00% 15/01/2027	417.339	0,19
IRLAND				USD	1.085.000 Ziggo Secured Finance 5.50% 15/01/2027	1.081.431	0,51
USD	365.000 AerCap Ireland 3.95% 01/02/2022	372.972	0,17	Summe Niederlande		3.332.375	1,57
USD	1.431.000 AerCap Ireland Capital Limited 5.00% 01/10/2021	1.529.624	0,72	VEREINIGTES KÖNIGREICH			
USD	640.000 Allegion plc 5.88% 15/09/2023	691.200	0,32	USD	404.000 International Game Tech 6.25% 15/02/2022	430.595	0,20
USD	200.000 Ardagh Packaging Finance 4.63% 15/05/2023	202.584	0,09	USD	765.000 International Game Tech P.P. 144A 6.50% 15/02/2025	828.113	0,39
USD	268.000 Ardagh Packaging Finance 7.25% 15/05/2024	286.396	0,13	USD	1.517.000 Virgin Media Finance plc 5.75% 15/01/2025	1.548.895	0,72
USD	805.000 Ardagh Packaging Finance plc 6.75% 31/01/2021	835.589	0,39	USD	625.000 Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/01/2026	636.409	0,30
Summe Irland		3.918.365	1,82	USD	234.000 Virgin Media Secured Finance plc 5.50% 15/08/2026	239.139	0,11
				Summe Vereinigtes Königreich		3.683.151	1,72

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond*

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

				% des					% des
Nennwert	Anlage	Marktwert USD		Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD		Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Anleihen (Fortsetzung)				
VEREINIGTE STAATEN					VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				
USD	10.000	Acadia Healthcare 5.63% 15/02/2023	10.189	0,00	USD	1.716.000	Carrizo Oil & Gas Inc. 6.25% 15/04/2023	1.707.420	0,79
USD	177.000	Aes Corp. 6.00% 15/05/2026	187.106	0,09	USD	241.000	CCO Holdings LLC 5.75% 15/01/2024	254.978	0,12
USD	400.000	AES Corp. 4.88% 15/05/2023	406.026	0,19	USD	150.000	Cedar Fair LP 5.38% 01/06/2024	158.937	0,07
USD	314.000	AES Corp. 7.38% 01/07/2021	361.474	0,17	USD	355.000	Centene Corp. 4.75% 15/05/2022	366.878	0,17
USD	45.000	Allegion US Holding Company Inc. 5.75% 01/10/2021	47.059	0,02	USD	642.000	Centene Corp. 6.13% 15/02/2024	695.976	0,32
USD	982.000	Ally Financial Inc. 4.13% 13/02/2022	995.699	0,46	USD	15.000	Centurylink Inc. 5.63% 01/04/2025	14.499	0,01
USD	23.000	Ally Financial Inc. 4.63% 19/05/2022	23.713	0,01	USD	186.000	Centurylink Inc. 6.45% 15/06/2021	199.397	0,09
USD	712.000	Ally Financial Inc. 4.63% 30/03/2025	733.837	0,34	USD	1.191.000	Centurylink Inc. 7.50% 01/04/2024	1.277.644	0,60
USD	1.350.000	Ally Financial Inc. 5.13% 30/09/2024	1.439.478	0,68	USD	1.231.000	Chemours 7.00% 15/05/2025	1.212.830	0,57
USD	426.000	Ally Financial Inc. 5.75% 20/11/2025	446.878	0,21	USD	56.000	Chemours Company 6.63% 15/05/2023	54.833	0,03
USD	186.000	AMC Networks Inc. 5.00% 01/04/2024	187.238	0,09	USD	498.000	Choice Hotel International Inc. 5.75% 01/07/2022	547.974	0,26
USD	180.000	Amsurg Corp. 5.63% 30/11/2020	185.608	0,09	USD	629.000	CHS - Community Health Systems Inc. 5.13% 01/08/2021	620.902	0,29
USD	265.000	Antero Resources Corp. 5.13% 01/12/2022	267.931	0,13	USD	633.000	CHS - Community Health Systems Inc. 6.88% 01/02/2022	545.561	0,25
USD	538.000	Antero Resources Corp. 5.63% 01/06/2023	548.297	0,26	USD	630.000	CIT Group Inc. 5.38% 15/05/2020	673.731	0,31
USD	131.000	Apx Group Inc. 6.38% 01/12/2019	132.026	0,06	USD	494.000	Concho Resources Inc. 5.50% 01/10/2022	514.558	0,24
USD	231.000	Apx Group Inc. 8.75% 01/12/2020	225.329	0,11	USD	1.167.000	Concho Resources Inc. 5.50% 01/04/2023	1.214.876	0,57
USD	480.000	Aramark Services Inc. 5.13% 15/01/2024	497.410	0,23	USD	284.000	Concho Resources Inc. 6.50% 15/01/2022	295.491	0,14
USD	147.000	Asbury Automotive Group 6.00% 15/12/2024	152.450	0,07	USD	19.000	Constellation Brands 3.75% 01/05/2021	20.057	0,01
USD	181.000	B&G Foods Inc. 4.63% 01/06/2021	186.411	0,09	USD	72.000	Constellation Brands 4.25% 01/05/2023	76.452	0,04
USD	486.000	Ball Corp. 4.38% 15/12/2020	521.692	0,24	USD	941.000	Constellation Brands 4.75% 15/11/2024	1.017.926	0,47
USD	615.000	Ball Corp. 5.25% 01/07/2025	664.554	0,31	USD	195.000	Constellation Brands Inc. 4.75% 01/12/2025	210.996	0,10
USD	448.000	Berry Plastics Corp 5.50% 15/05/2022	465.647	0,22	USD	1.160.000	Continental Resources Inc. 3.80% 01/06/2024	1.067.200	0,50
USD	185.000	Berry Plastics Corp. 5.13% 15/07/2023	188.075	0,09	USD	168.000	Continental Resources Inc. 4.50% 15/04/2023	162.196	0,08
USD	665.000	Berry Plastics Corp. 5.13% 15/07/2023	676.052	0,32	USD	851.000	Davita Healthcare Partners Inc. 5.75% 15/08/2022	891.269	0,42
USD	249.000	Boyd Gaming Corp. 6.88% 15/05/2023	269.991	0,13	USD	175.000	DaVita Healthcare Partners Inc. 5.13% 15/07/2024	178.367	0,08
USD	298.000	Calatlantic Group Inc. 6.25% 15/12/2021	328.918	0,15	USD	519.000	Denbury Resources Inc. 9.00% 15/05/2021	546.247	0,25
USD	565.000	Calpine Corp. 5.25% 01/06/2026	572.599	0,27	USD	100.000	Diamondback Energy Inc. 7.63% 01/10/2021	106.000	0,05
USD	703.000	Calpine Corp. 5.38% 15/01/2023	702.234	0,33					

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond*

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

				Marktwert	% des Netto- vermögens			Marktwert	% des Netto- vermögens	
Nennwert	Anlage			USD		Nennwert	Anlage	USD		
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)						Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)						Anleihen (Fortsetzung)				
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)						VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				
USD	302.000	Dish DBS Corp 5.88% 15/11/2024		298.811	0,14	USD	2.319.000	Laredo Petroleum Inc. 6.25% 15/03/2023	2.271.391	1,05
USD	235.000	Dish Dbs Corp. 6.75% 01/06/2021		253.361	0,12				717.130	0,33
USD	665.000	Dr Horton Inc. 4.75% 15/02/2023		715.969	0,33	USD	686.000	Lennar Corp 4.50% 15/06/2019		
USD	1.380.000	E*Trade Financial Corp. 4.63% 15/09/2023		1.435.414	0,67	USD	119.000	Lennar Corp 4.75% 01/04/2021	126.727	0,06
USD	108.000	Eagle Materials Inc. 4.50% 01/08/2026		109.881	0,05	USD	1.110.000	Level 3 Financing 5.38% 15/01/2024	1.160.555	0,54
USD	1.050.000	Energy Transfer Equity LP 5.50% 01/06/2027		1.048.772	0,49	USD	327.000	Level 3 Financing Inc. 5.38% 15/08/2022	341.707	0,16
USD	28.000	Equinix Inc. 4.88% 01/04/2020		29.097	0,01	USD	169.000	Manitowoc Foodservice 9.50% 15/02/2024	194.350	0,09
USD	43.000	Equinix Inc. 5.38% 01/01/2022		45.761	0,02	USD	192.000	Meritage Homes Corp 6.00% 01/06/2025	204.480	0,10
USD	785.000	Equinix Inc. 5.38% 01/04/2023		822.990	0,39					
USD	145.000	Freeport-Mcmoran Copper & Gold Inc. 3.55% 01/03/2022		131.686	0,06	USD	312.000	Meritage Homes Corp. 7.00% 01/04/2022	347.671	0,16
USD	519.000	Freeport-Mcmoran Inc. 3.88% 15/03/2023		468.398	0,22	USD	583.000	MGM Resorts International 4.63% 01/09/2026	569.014	0,27
USD	739.000	Freeport-Mcmoran Inc. 4.55% 14/11/2024		670.705	0,31	USD	736.000	MGM Resorts International 6.00% 15/03/2023	798.756	0,37
USD	471.000	Fresenius Medical Care P.P. 144A 5.88% 31/01/2022		535.586	0,25	USD	434.000	MGM Resorts International 6.75% 01/10/2020	487.117	0,23
USD	27.000	Frontier Communications Corp. 6.88% 15/01/2025		24.040	0,01	USD	606.000	MGM Resorts International 11.38% 01/03/2018	681.589	0,32
USD	11.000	Frontier Communications Corp. 7.63% 15/04/2024		10.301	0,00	USD	615.000	Molina Healthcare Inc. 5.38% 15/11/2022	635.356	0,30
USD	98.000	Frontier Communications Corp. 8.50% 15/04/2020		106.211	0,05	USD	118.000	Mplx LP 4.50% 15/07/2023	120.461	0,06
USD	109.000	Group 1 Automotive Inc. 5.00% 01/06/2022		109.885	0,05	USD	1.455.000	Mplx LP 4.88% 01/12/2024	1.507.406	0,70
USD	20.000	HCA Holdings Inc. 6.25% 15/02/2021		21.685	0,01	USD	429.000	Mplx LP 4.88% 01/06/2025	444.041	0,21
						USD	82.000	Mplx LP 5.50% 15/02/2023	84.787	0,04
						USD	211.000	MSCI Inc. 4.75% 01/08/2026	214.506	0,10
USD	560.000	Hca Inc. 4.50% 15/02/2027		564.390	0,26	USD	155.000	Navient Corp. 6.63% 26/07/2021	156.315	0,07
USD	756.000	HCA Inc. 4.75% 01/05/2023		790.886	0,37	USD	289.000	Navient LLC 7.25% 25/01/2022	294.384	0,14
USD	1.645.000	HCA Inc. 5.25% 15/04/2025		1.758.965	0,82	USD	968.000	Netflix Inc. 5.75% 01/03/2024	1.048.401	0,48
USD	428.000	HCA Inc. 5.25% 15/06/2026		455.116	0,21					
USD	1.381.000	HCA Inc. 5.38% 01/02/2025		1.429.921	0,67	USD	1.157.000	Newfield Exploration Company 5.63% 01/07/2024	1.183.038	0,55
USD	266.000	HCA Inc. 5.88% 01/05/2023		282.806	0,13	USD	221.000	NRG Energy Inc. 6.25% 15/07/2022	226.210	0,11
USD	170.000	HCA Inc. 5.88% 15/02/2026		180.966	0,08	USD	324.000	NRG Energy Inc. 6.25% 01/05/2024	325.719	0,15
USD	124.000	Healthsouth Corp 5.75% 01/11/2024		128.250	0,06	USD	44.000	NRG Energy Inc. 7.63% 15/01/2018	46.975	0,02
USD	575.000	Healthsouth Corp 5.75% 15/09/2025		602.313	0,28	USD	1.076.000	NRG Yield Operating LLC 5.38% 15/08/2024	1.106.579	0,51
USD	64.000	Hertz 6.25% 15/10/2022		66.357	0,03					
USD	254.000	Huntsman International 5.13% 15/11/2022		264.766	0,12	USD	260.000	Oasis Petroleum Inc. 6.88% 15/03/2022	250.250	0,12
USD	196.000	Huntsman International LLC 4.88% 15/11/2020		204.695	0,10	USD	770.000	Oasis Petroleum Inc. 6.88% 15/01/2023	739.200	0,34
USD	210.000	L Brands Inc. 8.50% 15/06/2019		245.781	0,11	USD	229.000	Outfront Media Cap LLC 5.63% 15/02/2024	238.640	0,11
USD	68.000	Laredo Petroleum Inc. 5.63% 15/01/2022		66.300	0,03					

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond*

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

		% des				% des			
Nennwert	Anlage	Marktwert USD	Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	Netto- vermögens		
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					
USD	380.000	Outfront Media Cap LLC 5.88% 15/03/2025	400.944	0,19	USD	312.000	Synovus Financial Corp. 7.88% 15/02/2019	347.100	0,16
USD	146.000	Penske Automotive Group 5.50% 15/05/2026	146.318	0,07	USD	280.000	Targa Resources Partners 6.75% 15/03/2024	301.000	0,14
USD	265.000	Penske Automotive Group Inc. 5.38% 01/12/2024	268.135	0,13	USD	97.000	Teleflex Inc. 4.88% 01/06/2026	100.531	0,05
USD	732.000	PTC Inc. 6.00% 15/05/2024	785.070	0,37	USD	180.000	Tempur Sealy International In 5.63% 15/10/2023	190.203	0,09
USD	18.000	Qep Resources Inc. 5.25% 01/05/2023	17.784	0,01	USD	203.000	Tenet Healthcare Corp. 4.75% 01/06/2020	207.143	0,10
USD	630.000	Qualitytech LP 5.88% 01/08/2022	649.278	0,30	USD	1.002.000	Tenet Healthcare Corp. 6.00% 01/10/2020	1.061.649	0,50
USD	603.000	Reynolds Group Issuer Inc. 5.75% 15/10/2020	622.631	0,29	USD	638.000	Tenet Healthcare Corp. 6.75% 15/06/2023	593.506	0,28
USD	336.000	Reynolds Group Issuer Inc. 8.25% 15/02/2021	350.374	0,16	USD	149.000	Tenet Healthcare Corp. 8.13% 01/04/2022	148.940	0,07
USD	142.000	Rite Aid Corp 6.75% 15/06/2021	150.029	0,07	USD	199.000	Tenneco Inc. 5.00% 15/07/2026	202.296	0,09
USD	866.000	RSP Permian Inc. 6.63% 01/10/2022	908.157	0,42	USD	17.000	Tesoro Logistics LP 5.50% 15/10/2019	18.176	0,01
USD	1.573.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.63% 01/03/2025	1.680.301	0,77	USD	999.000	Tesoro Logistics LP 6.25% 15/10/2022	1.061.507	0,50
USD	606.000	Sally Holdings/Sally Cap 5.63% 01/12/2025	652.078	0,30	USD	134.000	Tesoro Logistics LP 6.38% 01/05/2024	143.314	0,07
USD	340.000	Sally Holdings/Sally Cap 5.75% 01/06/2022	356.359	0,17	USD	686.000	T-Mobile USA Inc. 6.00% 01/03/2023	734.655	0,34
USD	700.000	Scientific Games Corp. 10.00% 01/12/2022	649.250	0,30	USD	42.000	T-Mobile USA Inc. 6.13% 15/01/2022	44.640	0,02
USD	319.000	Sesi LLC 6.38% 01/05/2019	318.971	0,15	USD	100.000	T-Mobile USA Inc. 6.13% 15/01/2022	106.286	0,05
USD	94.000	Sesi LLC 7.13% 15/12/2021	92.331	0,04	USD	1.193.000	T-Mobile USA Inc. 6.50% 15/01/2024	1.295.257	0,60
USD	51.000	Slm Corp. 8.00% 25/03/2020	54.780	0,03	USD	661.000	T-Mobile USA Inc. 6.50% 15/01/2026	732.933	0,34
USD	207.000	SM Energy Company 6.75% 15/09/2026	209.458	0,10	USD	14.000	T-Mobile USA Inc. 6.54% 28/04/2020	14.471	0,01
USD	795.000	Spectrum Brands Inc. 5.75% 15/07/2025	864.630	0,41	USD	171.000	T-Mobile USA Inc. 6.63% 01/04/2023	183.566	0,09
USD	181.000	Spectrum Brands Inc. 6.63% 15/11/2022	195.982	0,09	USD	200.000	T-Mobile USA Inc. 6.63% 28/04/2021	211.200	0,10
USD	369.000	Springleaf Finance 8.25% 15/12/2020	404.904	0,19	USD	102.000	T-Mobile USA Inc. 6.73% 28/04/2022	107.547	0,05
USD	64.000	Springleaf Finance Corp. 7.75% 01/10/2021	67.492	0,03	USD	240.000	T-Mobile USA Inc. 6.84% 28/04/2023	259.180	0,12
USD	28.000	Springleaf Finance Corp. 8.25% 01/10/2023	29.575	0,01	USD	245.000	Toll Bros 4.88% 15/11/2025	252.377	0,12
USD	153.000	Sprint Communications Inc. 6.00% 15/11/2022	142.939	0,07	USD	418.000	Toll Brothers Finance Corp. 5.63% 15/01/2024	447.962	0,21
USD	944.000	Sprint Corp 7.63% 15/02/2025	939.280	0,44	USD	112.000	Transdigm Inc. 6.00% 15/07/2022	118.817	0,06
USD	560.000	Sprint Corp. 7.13% 15/06/2024	545.731	0,25	USD	331.000	Transdigm Inc. 6.50% 15/07/2024	350.279	0,16
USD	136.000	Sprint Corp. 7.25% 15/09/2021	136.634	0,06	USD	951.000	Transdigm Inc. 6.50% 15/05/2025	989.135	0,46
USD	578.000	Sprint Corp. 7.88% 15/09/2023	581.523	0,27					
USD	665.000	Standard Pacific Corp. 5.88% 15/11/2024	712.737	0,33					

*Siehe Erläuterung 1.

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (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)					KANADA				
USD	40.000	Transdigm Inc. 7.50% 15/07/2021	42.363	0,02	USD	490.000	Burger King 4.63% 15/01/2022	508.147	0,24
USD	282.000	United Rentals North America Inc. 5.88% 15/09/2026	289.713	0,14	USD	1.023.000	MDC Partners Inc. 6.50% 01/05/2024	948.750	0,44
USD	180.000	United Rentals North America Inc. 5.75% 15/11/2024	187.029	0,09	USD	200.000	Quebecor Media Inc. 5.75% 15/01/2023	208.870	0,10
USD	368.000	United Rentals North America Inc. 6.13% 15/06/2023	386.843	0,18	USD	342.000	Teck Resources Limited 8.50% 01/06/2024	392.445	0,18
USD	545.000	Verisign Inc. 4.63% 01/05/2023	556.252	0,26	USD	69.000	Valeant Pharmaceuticals International Inc. P.P. 144A 5.63% 01/12/2021	61.801	0,03
USD	758.000	Verisign Inc. 5.25% 01/04/2025	797.784	0,37	USD	707.000	Videotron Limited 5.00% 15/07/2022	737.260	0,34
USD	1.031.000	Western Gas Partners LP 3.95% 01/06/2025	1.020.870	0,48	USD	118.000	Vpii Escrow Corp. P.P. 144A 7.50% 15/07/2021	114.622	0,05
USD	255.000	Western Gas Partners LP 4.00% 01/07/2022	262.037	0,12	USD	894.000	VRX Escrow Corp. P.P. 144A 5.88% 15/05/2023	774.043	0,36
USD	228.000	Whitewave Foods Company 5.38% 01/10/2022	257.667	0,12	USD	1.419.000	VRX Escrow Corp. P.P. 144A 6.13% 15/04/2025	1.226.272	0,58
USD	615.000	Whiting Petroleum Corp. 5.75% 15/03/2021	570.895	0,27	Summe Kanada		4.972.210	2,32	
USD	998.000	Williams Companies Inc. 3.70% 15/01/2023	970.934	0,46	KAIMANINSELN				
USD	1.394.000	Williams Companys Inc. 4.55% 24/06/2024	1.427.777	0,67	USD	245.000	UPCB Finance IV Limited 5.38% 15/01/2025	248.785	0,12
USD	1.658.000	WPX Energy Inc. 6.00% 15/01/2022	1.650.697	0,78	Summe Kaimaninseln		248.785	0,12	
USD	436.000	Zayo Group LLC 6.00% 01/04/2023	456.810	0,21	DEUTSCHLAND				
USD	793.000	Zayo Group LLC 6.38% 15/05/2025	844.862	0,39	USD	363.000	Schaeffler 4.50% 15/09/2023	365.411	0,17
Summe Vereinigte Staaten			89.339.814	41,70	Summe Deutschland		365.411	0,17	
Summe Anleihen			109.074.511	50,92	IRLAND				
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind			109.074.511	50,92	USD	341.000	Grifols Worldwide Operations Limited 5.25% 01/04/2022	353.445	0,16
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt					Summe Irland		353.445	0,16	
Anleihen					JERSEY - KANALINSELN				
BERMUDAS					USD	505.000	Adient Global Holdings 4.88% 15/08/2026	506.701	0,24
USD	710.000	IHS Markit Limited 5.00% 01/11/2022	756.746	0,35	Summe Jersey - Kanalinseln		506.701	0,24	
Summe Bermudas			756.746	0,35	LUXEMBURG				
					USD	294.000	ARD Finance SA 7.13% 15/09/2023	293.265	0,14
					USD	275.000	Camelot Finance SA 7.88% 15/10/2024	284.281	0,13

*Siehe Erläuterung 1.

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)			
LUXEMBURG (Fortsetzung)				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
USD	112.000 ConvaTec Finance 8.25% 15/01/2019	112.082	0,05	USD	546.000 American Builders & Contractors Supply Company Inc. P.P. 144A 5.63% 15/04/2021	568.523	0,27
USD	334.000 Fage International 5.63% 15/08/2026	344.603	0,16	USD	175.000 Amsurg Corp 5.63% 15/07/2022	179.168	0,08
USD	357.000 Mallinckrodt International Finance 5.50% 15/04/2025	340.410	0,16	USD	335.000 Ancestry.com Inc. 11.00% 15/12/2020	359.288	0,17
USD	27.000 Mallinckrodt International Finance-Mallinckrodt 5.63% 15/10/2023	26.042	0,01	USD	816.000 Apx Group Inc. 7.88% 01/12/2022	855.993	0,41
USD	425.000 Nielsen Company Luxembourg Sarl 5.50% 01/10/2021	443.883	0,21	USD	188.000 Apx Group Inc. 7.88% 01/12/2022	196.930	0,09
	Summe Luxemburg	1.844.566	0,86	USD	353.000 Axalta Coating Systeme 4.88% 15/08/2024	364.455	0,17
NIEDERLANDE				USD	739.000 Beacon Roofing Supply 6.38% 01/10/2023	801.815	0,38
USD	823.000 NXP BV 4.63% 15/06/2022	868.265	0,41	USD	189.000 Beazer Homes USA 8.75% 15/03/2022	199.584	0,09
USD	324.000 NXP BV/nxp Funding 4.13% 01/06/2021	347.895	0,16	USD	707.000 Boyd Gaming Corp. 6.38% 01/04/2026	757.833	0,35
USD	751.000 Playa Resorts Holding BV 8.00% 15/08/2020	772.554	0,36	USD	335.000 Building Materials Corp. 6.00% 15/10/2025	360.125	0,17
	Summe Niederlande	1.988.714	0,93	USD	142.000 Callon Petroleum Company 6.13% 01/10/2024	147.325	0,07
VEREINIGTES KÖNIGREICH				USD	174.000 Calpine Corp. P.P. 144A 6.00% 15/01/2022	182.535	0,09
USD	392.000 Sensata Technologies UK Financing 6.25% 15/02/2026	424.830	0,20	USD	94.000 Cco Holdings LLC P.P. 144A 5.88% 01/05/2027	99.790	0,05
	Summe Vereinigtes Königreich	424.830	0,20	USD	8.000 CCO Holdings LLC 5.13% 01/05/2023	8.350	0,00
VEREINIGTE STAATEN				USD	437.000 CCO Holdings LLC 5.25% 30/09/2022	457.653	0,21
USD	447.000 Abc Supply Company Inc. 5.75% 15/12/2023	469.350	0,22	USD	561.000 CCO Holdings LLC 5.38% 01/05/2025	587.260	0,27
USD	180.000 Acadia Healthcare 5.13% 01/07/2022	178.179	0,08	USD	681.000 CCO Holdings LLC 5.50% 01/05/2026	709.942	0,33
USD	347.000 Acadia Healthcare Company 6.50% 01/03/2024	364.350	0,17	USD	63.000 CCO Holdings LLC 5.75% 15/02/2026	66.938	0,03
USD	1.267.000 Activision Blizzard Inc. P.P. 144A 6.13% 15/09/2023	1.392.928	0,65	USD	1.024.000 CCO Holdings LLC 5.88% 01/04/2024	1.094.727	0,52
USD	125.000 Alere Inc. P.P. 144A 6.38% 01/07/2023	128.125	0,06	USD	69.000 Cequel Communications Holdings P.P. 144A 5.13% 15/12/2021	69.232	0,03
USD	683.000 Alliance Data Systems Corp P.P. 144A 6.38% 01/04/2020	694.953	0,32	USD	119.000 Cequel Communications Holdings 6.38% 15/09/2020	122.988	0,06
USD	480.000 Altice US Finance I Corp P.P. 144A 5.38% 15/07/2023	495.000	0,23	USD	306.000 Cequel Communications Holdings I LLC P.P. 144A 5.13% 15/12/2021	307.148	0,14
USD	549.000 Altice US Finance II Corp P.P. 144A 7.75% 15/07/2025	593.579	0,28	USD	295.000 Cheniere Corp. 7.00% 30/06/2024	319.342	0,15
USD	667.000 Altice USA Finance 5.50% 15/05/2026	688.631	0,32				

*Siehe Erläuterung 1.

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 1.281.000	CIT Group Inc. 5.50% 15/02/2019	1.354.658	0,64	USD 247.000	Frontier Communications 10.50% 15/09/2022	262.609	0,12
USD 228.000	CIT Group Inc. 6.63% 01/04/2018	242.182	0,11	USD 371.000	Frontier Communications Corp. 8.75% 15/04/2022	381.188	0,18
USD 743.000	Crown Americas 4.25% 30/09/2026	743.372	0,35	USD 225.000	Frontier Communications Corp. 8.88% 15/09/2020	242.892	0,11
USD 1.168.000	Crownrock LP P.P. 144A 7.75% 15/02/2023	1.258.520	0,58	USD 2.241.000	Frontier Communications Corp. 11.00% 15/09/2025	2.347.884	1,11
USD 456.000	CSC Holdings LLC 5.50% 15/04/2027	465.599	0,22	USD 391.000	Gates Global LLC P.P. 144A 6.00% 15/07/2022	371.919	0,17
USD 237.000	CSC Holdings LLC 6.75% 15/11/2021	251.263	0,12	USD 111.000	Gibraltar Industries Inc. 6.25% 01/02/2021	115.296	0,05
USD 578.000	Cyrusone LP 6.38% 15/11/2022	612.871	0,29	USD 37.000	Gl Capital LP 5.38% 01/11/2023	40.006	0,02
USD 620.000	Diamond 1 Finance Corp. 6.02% 15/06/2026	678.369	0,33	USD 597.000	GLP Capital LP 5.38% 15/04/2026	642.871	0,29
USD 277.000	Diamond 1 Finance Corp. 7.13% 15/06/2024	305.537	0,14	USD 101.000	Group 1 Automotive Inc. 5.25% 15/12/2023	101.626	0,05
USD 590.000	Diamond 1&2 Finance 5.45% 15/06/2023	631.908	0,29	USD 212.000	Hanesbrands Inc. 4.63% 15/05/2024	218.474	0,10
USD 389.000	Diamond 1&2 Finance 5.88% 15/06/2021	413.192	0,19	USD 513.000	HD Supply Inc. P.P. 144A 5.25% 15/12/2021	545.016	0,25
USD 988.000	Dish Dbs Corp. 7.75% 01/07/2026	1.049.631	0,49	USD 902.000	HD Supply Inc. 5.75% 15/04/2024	948.227	0,44
USD 617.000	DISH DBS Corp. 5.88% 15/07/2022	634.075	0,30	USD 417.000	Hertz Corp. 5.50% 15/10/2024	416.120	0,19
USD 976.000	Dollar Tree Inc. 5.75% 01/03/2023	1.049.893	0,49	USD 273.000	Hilton Escrow LLC 4.25% 01/09/2024	279.825	0,13
USD 335.000	Eco Services Operations LLC P.P. 144A 8.50% 01/11/2022	350.075	0,16	USD 93.000	Holly Energy Partners 6.00% 01/08/2024	95.790	0,04
USD 169.000	Emdeon Inc. P.P. 144A 6.00% 15/02/2021	179.140	0,08	USD 243.000	Hologic Inc. P.P. 144A 5.25% 15/07/2022	258.552	0,12
USD 161.000	Emdeon Inc. 11.00% 31/12/2019	169.493	0,08	USD 866.000	Hub International Limited P.P. 144A 7.88% 01/10/2021	883.060	0,41
USD 257.000	Endo Finance LLC P.P. 144A 6.00% 15/07/2023	233.290	0,11	USD 361.000	Hub International Limited FRN 15/02/2021	377.245	0,18
USD 288.000	Endo Finance LLC P.P. 144A 6.00% 01/02/2025	255.960	0,12	USD 443.000	Hughes Satellite Systems Corp. 5.25% 01/08/2026	437.872	0,20
USD 300.000	Entegris Inc. P.P. 144A 6.00% 01/04/2022	312.000	0,15	USD 640.000	Ims Health Inc. 5.00% 15/10/2026	667.200	0,31
USD 931.000	Equinix Inc. 5.88% 15/01/2026	1.003.832	0,47	USD 39.000	Infor US inc. 5.75% 15/08/2020	41.096	0,02
USD 1.009.000	Extraction Oil & Gas 7.88% 15/07/2021	1.054.405	0,49	USD 925.000	Interval Acquisition 5.63% 15/04/2023	959.687	0,45
USD 352.000	First Data Corp 5.00% 15/01/2024	358.693	0,17	USD 176.000	Italics Merger Sub P.P. 144A 7.13% 15/07/2023	165.440	0,08
USD 1.380.000	First Data Corp P.P. 144A 5.75% 15/01/2024	1.417.868	0,66	USD 750.000	Jaguar Holding Company 6.38% 01/08/2023	782.813	0,37
USD 1.154.000	First Data Corp P.P. 144A 7.00% 01/12/2023	1.222.853	0,57	USD 1.061.000	KFC Holding-Pizza Hut Holdings LLC-Taco Bell America LLC 5.25% 01/06/2026	1.119.647	0,52
USD 203.000	First Data Corp. P.P. 144A 5.38% 15/08/2023	209.307	0,10	USD 406.000	Lamar Media Corp. 5.38% 15/01/2024	431.974	0,20
USD 190.000	Fresenius Medical Care US Finance II Inc. P.P. 144A 4.75% 15/10/2024	200.310	0,09				

*Siehe Erläuterung 1.

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	311.000 Lamar Media Corp. 5.75% 01/02/2026	334.725	0,16	USD	566.000 Parsley Energy LLC P.P. 144A 7.50% 15/02/2022	604.205	0,28
USD	13.000 Level 3 Financing Inc. FRN 15/01/2018	13.098	0,01	USD	710.000 Pdc Energy Inc. 6.13% 15/09/2024	737.303	0,34
USD	217.000 Level 3 Financing Inc. 5.25% 15/03/2026	224.595	0,10	USD	340.000 Pinnacle Foods Inc. 5.88% 15/01/2024	363.800	0,17
USD	392.000 LTF Merger Sub Inc. P.P. 144A 8.50% 15/06/2023	404.250	0,19	USD	602.000 Platform Specialty Products 10.38% 01/05/2021	650.160	0,31
USD	581.000 Match Group Inc. 6.38% 01/06/2024	634.016	0,30	USD	95.000 Platform Specialty Products Corp. P.P. 144A 6.50% 01/02/2022	92.863	0,04
USD	674.000 Mednax Inc. 5.25% 01/12/2023	706.487	0,33	USD	387.000 Post Holdings Inc. 5.00% 15/08/2026	385.907	0,18
USD	207.000 MGM Growth 4.50% 01/09/2026	207.335	0,10	USD	530.000 Post Holdings Inc. P.P. 144A 6.00% 15/12/2022	560.509	0,26
USD	158.000 MGP Escrow Issuer 5.63% 01/05/2024	170.646	0,08	USD	701.000 Post Holdings Inc. 7.75% 15/03/2024	779.491	0,36
USD	777.000 Microsemi Corp. 9.13% 15/04/2023	889.665	0,41	USD	644.000 PQ Corp. 6.75% 15/11/2022	683.831	0,32
USD	736.000 MPH Acquisition Holdings LLC 7.13% 01/06/2024	794.207	0,38	USD	532.000 Prestige Brands Inc. 6.38% 01/03/2024	567.591	0,26
USD	437.000 MSCI Inc. P.P. 144A 5.25% 15/11/2024	464.334	0,22	USD	296.000 Project Homestake Merger Corp P.P. 144A 8.88% 01/03/2023	317.830	0,15
USD	287.000 MSCI Inc. 5.75% 15/08/2025	308.166	0,14	USD	896.000 Provident Funding Associates LP P.P. 144A 6.75% 15/06/2021	904.378	0,42
USD	825.000 Navient Corp. 5.00% 26/10/2020	818.672	0,38	USD	255.000 Quicken Loans Inc. P.P. 144A 5.75% 01/05/2025	254.351	0,12
USD	730.000 Neptune Finco Corp. P.P. 144A 6.63% 15/10/2025	792.656	0,37	USD	408.000 Quintiles Transnational Corp. P.P. 144A 4.88% 15/05/2023	419.220	0,20
USD	157.000 Neptune Finco Corp. P.P. 144A 10.13% 15/01/2023	180.618	0,08	USD	80.000 Range Resources Corp. 5.75% 01/06/2021	81.400	0,04
USD	1.398.000 Neptune Finco Corp. P.P. 144A 10.88% 15/10/2025	1.640.413	0,77	USD	698.000 Reynolds Group Issuer 5.13% 15/07/2023	721.495	0,34
USD	368.000 Netflix Inc. 5.88% 15/02/2025	398.638	0,19	USD	774.000 Reynolds Group Issuer 7.00% 15/07/2024	830.942	0,39
USD	657.000 Novelis Corp. 5.88% 30/09/2026	674.246	0,31	USD	384.000 Rite Aid Corp. 6.13% 01/04/2023	415.200	0,19
USD	306.000 Novelis Corp. 6.25% 15/08/2024	325.657	0,15	USD	128.000 Rivers Pittsburgh LP 6.13% 15/08/2021	131.990	0,06
USD	624.000 NRG Energy Inc. 6.63% 15/01/2027	612.300	0,28	USD	323.000 Sabine Pass Liquefaction LLC 5.00% 15/03/2027	331.883	0,15
USD	517.000 NRG Energy Inc. 7.25% 15/05/2026	529.873	0,25	USD	499.000 Sabine Pass Liquefaction LLC 5.88% 30/06/2026	544.222	0,25
USD	95.000 NRG Yield Operating LLC 5.00% 15/09/2026	92.988	0,04	USD	966.000 Sba Communications 4.88% 01/09/2024	971.458	0,46
USD	35.000 Onemain Financial Holdings Inc. P.P. 144A 6.75% 15/12/2019	36.794	0,02	USD	750.000 SBA Companycommunications 4.88% 15/07/2022	775.763	0,36
USD	960.000 Onemain Financial Holdings Inc. P.P. 144A 7.25% 15/12/2021	1.011.264	0,47	USD	998.000 Scientific Games Corporation 7.00% 01/01/2022	1.060.375	0,49
USD	357.000 Owens-Brockway 5.88% 15/08/2023	384.607	0,18	USD	424.000 Serta Simmons Holdings LLC 8.13% 01/10/2020	443.610	0,21
USD	560.000 Owens-Brockway 6.38% 15/08/2025	620.900	0,29				
USD	1.069.000 Parsley Energy 6.25% 01/06/2024	1.106.415	0,51				

*Siehe Erläuterung 1.

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	74.000	Signode Industrial Group Lux SA P.P. 144A 6.38% 01/05/2022	75.110	0,04	USD	16.000	Wayne Merger Sub LLC 8.25% 01/08/2023	16.260	0,01
USD	577.000	Sirius XM Radio Inc. P.P. 144A 5.38% 15/04/2025	600.017	0,28	USD	143.000	Wesco Distribution 5.38% 15/06/2024	144.430	0,07
USD	647.000	Solera LLC 10.50% 01/03/2024	723.799	0,34	USD	579.000	WR Grace & Company 5.13% 01/10/2021	615.911	0,29
USD	426.000	Springs Industries Inc. 6.25% 01/06/2021	444.636	0,21	USD	636.000	Zebra Technologies Company 7.25% 15/10/2022	692.951	0,32
USD	1.396.000	Sprint Communications Inc. P.P. 144A 7.00% 01/03/2020	1.505.348	0,70	USD	81.000	Zekelman Industries 9.88% 15/06/2023	85.253	0,04
USD	125.000	Spx Flow Inc. 5.63% 15/08/2024	126.875	0,06	USD	306.000	ZF North America Capital Inc. P.P. 144A 4.50% 29/04/2022	323.878	0,15
USD	462.000	Spx Flow Inc. 5.88% 15/08/2026	470.085	0,22			Summe Vereinigte Staaten	85.050.074	39,69
USD	434.000	Sterigenics-Nordion 6.50% 15/05/2023	454.616	0,21			Summe Anleihen	96.511.482	45,04
USD	432.000	Sugarhouse HSP Gaming P.P. 144A 6.38% 01/06/2021	433.080	0,20	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt				
USD	123.000	Surgical Care Affiliates Inc. P.P. 144A 6.00% 01/04/2023	129.458	0,06				96.511.482	45,04
USD	175.000	Tallgrass Energy Partners 5.50% 15/09/2024	176.750	0,08	Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				
USD	302.000	Targa Resources Inc. 4.25% 15/11/2023	291.136	0,14	Anleihen				
USD	972.000	Targa Resources Partners 5.38% 01/02/2027	980.505	0,46	VEREINIGTE STAATEN				
USD	179.000	Targa Resources Partners LP 5.25% 01/05/2023	182.068	0,08	USD	338.000	Alliance Data Systems Corp. 5.38% 01/08/2022	331.240	0,15
USD	300.000	Taylor Morrison 5.88% 15/04/2023	315.750	0,15	USD	177.000	Aruba Investments Inc. P.P. 144A 8.75% 15/02/2023	181.425	0,08
USD	383.000	Taylor Morrison Communities Inc. P.P. 144A 5.25% 15/04/2021	397.399	0,19	USD	92.000	Hiland Partners LP P.P. 144A 7.25% 01/10/2020	95.335	0,04
USD	638.000	Tempur Sealy International Inc. 5.50% 15/06/2026	656.119	0,31	USD	110.000	National Financial Partners Corp. P.P. 144A 9.00% 15/07/2021	113.424	0,05
USD	663.000	The Scotts Miracle-Gro Company P.P. 144A 6.00% 15/10/2023	709.410	0,33	USD	419.000	Plastipak Holdings Inc. P.P. 144A 6.50% 01/10/2021	435.760	0,20
USD	678.000	Transdigm Inc. 6.38% 15/06/2026	703.425	0,33	USD	26.000	Tunica-Biloxi Gaming Authority P.P. 144A 9.00% 15/11/2016	11.245	0,01
USD	174.000	Treehouse Foods Inc. 6.00% 15/02/2024	188.138	0,09			Summe Vereinigte Staaten	1.168.429	0,53
USD	256.000	Univision Communications Inc. P.P. 144A 5.13% 15/05/2023	261.335	0,12			Summe Anleihen	1.168.429	0,53
USD	1.038.000	Univision Communications Inc. P.P. 144A 5.13% 15/02/2025	1.049.106	0,48	Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				
USD	349.000	US Concrete Inc. 6.38% 01/06/2024	362.960	0,17				1.168.429	0,53
USD	280.000	Valeant Pharmaceuticals International Inc. P.P. 144A 5.50% 01/03/2023	239.810	0,11	Wert der Anlagen insgesamt				
USD	69.000	Valvoline Finco Two 5.50% 15/07/2024	72.450	0,03	(Gesamtkosten: USD 198.954.860)				

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond*

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen					Anleihen (Fortsetzung)				
KANADA					VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				
USD	30.000	Bank of Nova Scotia 1.70% 11/06/2018	30.147	0,60	USD	150.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 2.50% 15/07/2022	153.102	3,06
USD	30.000	Canadian Natural Resources Limited 6.25% 15/03/2038	33.808	0,67	USD	8.000	Appalachian Power Company 4.40% 15/05/2044	8.680	0,17
USD	56.000	Cenovus Energy Inc. 5.20% 15/09/2043	50.063	1,00	USD	30.000	Appalachian Power Company 4.45% 01/06/2045	33.026	0,66
USD	40.000	Rogers Communications 3.00% 15/03/2023	41.641	0,83	USD	40.000	Apple Inc. 3.45% 09/02/2045	38.685	0,77
USD	35.000	Thomson Reuters Corp. 4.50% 23/05/2043	35.853	0,72	USD	10.000	Arizona Public 3.75% 15/05/2046	10.533	0,21
USD	28.000	Thomson Reuters Corp. 4.70% 15/10/2019	30.298	0,60	USD	61.000	AT&T Inc. 4.35% 15/06/2045	60.707	1,21
USD	100.000	Toronto-Dominion Bank 1.40% 30/04/2018	100.126	2,00	USD	60.000	Bank of America Corp 3.50% 19/04/2026	62.588	1,25
	Summe Kanada		321.936	6,42	USD	20.000	Bank of America Corp. 1.70% 25/08/2017	20.046	0,40
IRLAND					USD	75.000	Becton Dickinson 1.45% 15/05/2017	75.156	1,50
USD	35.000	Shire Acquisitions Investments Ireland Limited 1.90% 23/09/2019	35.053	0,70	USD	10.000	Becton Dickinson 4.69% 15/12/2044	11.487	0,23
	Summe Irland		35.053	0,70	USD	30.000	Berkshire Hathaway 1.15% 15/08/2018	29.987	0,60
LUXEMBURG					USD	20.000	Berkshire Hathaway 4.40% 15/05/2042	22.872	0,46
USD	30.000	Actavis Funding SCS 4.75% 15/03/2045	32.988	0,66	USD	20.000	Berkshire Hathaway 4.50% 01/02/2045	22.531	0,45
	Summe Luxemburg		32.988	0,66	USD	70.000	Berkshire Hathaway Energy Company 3.75% 15/11/2023	76.575	1,53
NIEDERLANDE					USD	30.000	Cisco Systems Inc. 1.40% 20/09/2019	30.041	0,60
USD	20.000	LYB International Finance BV 4.88% 15/03/2044	21.653	0,43	USD	60.000	Citigroup Inc. 3.40% 01/05/2026	62.033	1,24
	Summe Niederlande		21.653	0,43	USD	30.000	CMS Energy Corp. 4.88% 01/03/2044	35.219	0,70
VEREINIGTES KÖNIGREICH					USD	10.000	CMS Energy Corp. 5.05% 15/03/2022	11.391	0,23
USD	80.000	Sky plc 3.13% 26/11/2022	82.001	1,64	USD	30.000	CNA Financial Corp 4.50% 01/03/2026	32.480	0,65
	Summe Vereinigtes Königreich		82.001	1,64	USD	75.000	Coca-Cola Company 0.88% 27/10/2017	74.924	1,50
VEREINIGTE STAATEN					USD	20.000	Columbia Pipeline Group Inc. 5.80% 01/06/2045	23.824	0,48
USD	60.000	AbbVie Inc. 1.75% 06/11/2017	60.212	1,20	USD	25.000	Comcast Corp. 5.88% 15/02/2018	26.551	0,53
USD	20.000	Aetna Inc. 1.90% 07/06/2019	20.174	0,40	USD	55.000	Conagra Foods Inc. 3.20% 25/01/2023	57.370	1,15
USD	20.000	Aetna Inc. 4.38% 15/06/2046	20.887	0,42	USD	20.000	Connecticut Light & Power 2.50% 15/01/2023	20.506	0,41
USD	20.000	Alleghany Corp. 4.95% 27/06/2022	22.265	0,44	USD	10.000	Consolidated Edison 3.85% 15/06/2046	10.573	0,21
USD	20.000	Amgen Inc. 5.85% 01/06/2017	20.604	0,41	USD	40.000	Continental Resources Inc. 5.00% 15/09/2022	40.070	0,81
USD	30.000	Anadarko Petroleum Company 6.20% 15/03/2040	34.369	0,69					

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond*

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

			Marktwert	% des Netto- vermögens				Marktwert	% des Netto- vermögens
Nennwert	Anlage		USD		Nennwert	Anlage		USD	
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Anleihen (Fortsetzung)				
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)					VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				
USD	30.000	CVS Health Corp. 2.13% 01/06/2021	30.310	0,60	USD	30.000	Molson Coors Brew 5.00% 01/05/2042	34.828	0,69
USD	20.000	CVS Health Corp. 2.88% 01/06/2026	20.351	0,41	USD	10.000	Morgan Stanley 2.50% 21/04/2021	10.124	0,20
USD	65.000	Dte Energy Company 2.85% 01/10/2026	64.703	1,29	USD	20.000	Morgan Stanley 3.13% 27/07/2026	20.184	0,40
USD	65.000	Dte Energy Company 3.85% 01/12/2023	70.845	1,41	USD	20.000	Mplx LP 4.88% 01/06/2025	20.701	0,41
USD	10.000	Duke Energy Carolina 3.88% 15/03/2046	10.670	0,21	USD	20.000	Nisource Finance Corp. 5.25% 15/02/2043	23.965	0,48
USD	20.000	Duke Energy Corp. 3.75% 01/09/2046	19.522	0,39	USD	20.000	Noble Energy Inc. 5.25% 15/11/2043	20.480	0,41
USD	100.000	Duke Energy Corp. 3.95% 15/10/2023	109.544	2,18	USD	10.000	Northrop Grumman 3.25% 01/08/2023	10.693	0,21
USD	10.000	Enterprise Products 1.65% 07/05/2018	10.012	0,20	USD	60.000	Northrop Grumman Corp. 1.75% 01/06/2018	60.523	1,21
USD	40.000	Enterprise Products 5.10% 15/02/2045	43.329	0,86	USD	35.000	Oracle Corp. 4.00% 15/07/2046	36.171	0,71
USD	15.000	Enterprise Products Operating LLC 4.90% 15/05/2046	15.901	0,32	USD	25.000	Pacific Gas & Electric 2.45% 15/08/2022	25.560	0,51
USD	60.000	Eversource Energy 1.45% 01/05/2018	60.078	1,20	USD	30.000	Pacific Gas & Electric Company 3.75% 15/02/2024	32.852	0,66
USD	20.000	Express Scripts Holding Company 4.80% 15/07/2046	20.983	0,42	USD	20.000	Pacific Gas & Electric Company 4.75% 15/02/2044	23.922	0,48
USD	10.000	Fedex Corp. 4.55% 01/04/2046	11.170	0,22	USD	10.000	Pepsico Inc. 1.50% 22/02/2019	10.076	0,20
USD	10.000	Florida Power & Light 2.75% 01/06/2023	10.390	0,21	USD	50.000	Pfizer Inc. 1.20% 01/06/2018	50.060	1,00
USD	15.000	General Mills Inc. 1.40% 20/10/2017	15.040	0,30	USD	30.000	Phillips 66 2.95% 01/05/2017	30.295	0,60
USD	30.000	Goldman Sachs Group 3.75% 25/02/2026	31.640	0,63	USD	70.000	Plains All American Pipeline 3.85% 15/10/2023	69.937	1,40
USD	70.000	JPMorgan Chase 1.70% 01/03/2018	70.261	1,40	USD	10.000	Plains All American Pipeline 4.70% 15/06/2044	8.825	0,18
USD	45.000	JPMorgan Chase & Company 2.95% 01/10/2026	45.203	0,90	USD	100.000	Ppl Capital Fund 3.95% 15/03/2024	108.224	2,16
USD	55.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	51.917	1,03	USD	25.000	PPL Capital Funding Inc. 3.50% 01/12/2022	26.621	0,53
USD	34.000	L-3 Communications Corp. 3.95% 28/05/2024	36.286	0,73	USD	55.000	Scripps Networks 3.90% 15/11/2024	57.977	1,16
USD	40.000	Lockheed Martin Corp. 1.85% 23/11/2018	40.523	0,81	USD	100.000	Sempra Energy 4.05% 01/12/2023	109.580	2,19
USD	10.000	Marathon Oil Corp 5.20% 01/06/2045	9.102	0,18	USD	10.000	Southern California Edison 4.65% 01/10/2043	12.161	0,24
USD	50.000	McDonald's Corp. 5.35% 01/03/2018	52.795	1,05	USD	45.000	Southern Company 4.40% 01/07/2046	48.888	0,98
USD	30.000	Metlife Inc. 1.76% 15/12/2017	30.128	0,60	USD	10.000	Sysco Corp. 2.50% 15/07/2021	10.238	0,20
USD	10.000	Metlife Inc. 4.05% 01/03/2045	9.930	0,20	USD	20.000	Time Warner Inc. 6.25% 29/03/2041	25.893	0,52
USD	20.000	Microsoft Corp. 3.70% 08/08/2046	20.370	0,41	USD	135.000	Tyson Foods Inc. 2.65% 15/08/2019	138.388	2,76
					USD	30.000	United Technologies Corp. 5.38% 15/12/2017	31.510	0,63

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond*

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

				% des					% des		
Nennwert	Anlage	Marktwert	USD	Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert	USD	Netto- vermögens		
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (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	35.000	Unitedhealth Group Inc. 1.40% 15/12/2017	35.119	0,70	USD	50.000	Insurance and Annuity Association 4.90% 15/09/2044	56.567	1,13		
USD	50.000	Verizon Communications Inc. 4.67% 15/03/2055	52.588	1,05	USD	70.000	Liberty Mutual Group P.P. 144A 4.25% 15/06/2023	75.648	1,51		
USD	50.000	Voya Financial Inc. 4.80% 15/06/2046	50.173	0,99	USD	20.000	Metlife Inc. 4.37% 15/09/2023	22.166	0,44		
USD	20.000	Wec Energy Group Inc. 3.55% 15/06/2025	21.532	0,43	USD	75.000	Oncor Electric Delivery 5.00% 30/09/2017	77.729	1,54		
USD	36.000	Wells Fargo & Company 3.00% 22/04/2026	36.439	0,73	Summe Vereinigte Staaten		566.421	11,29			
USD	32.000	Williams Partners LP 5.10% 15/09/2045	31.566	0,63	Summe Anleihen		665.958	13,28			
USD	20.000	Yum! Brands Inc. 5.35% 01/11/2043	17.229	0,34	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt					665.958	13,28
Summe Vereinigte Staaten			3.443.793	68,72							
Summe Anleihen			3.937.424	78,57							
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind					Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente						
					Anleihen						
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt					AUSTRALIEN						
					USD	60.000	Woodside Finance Limited 3.65% 05/03/2025	60.742	1,21		
					USD	15.000	Woodside Finance Limited 3.70% 15/09/2026	15.160	0,30		
					Summe Australien		75.902	1,51			
Anleihen											
BERMUDAS					VEREINIGTE STAATEN						
USD	100.000	Bacardi Limited 2.75% 15/07/2026	99.537	1,99	USD	20.000	Northwestern Mutual Life Insurance Company 6.06% 30/03/2040	25.874	0,52		
Summe Bermudas			99.537	1,99	USD	40.000	The Guardian Life 4.88% 19/06/2064	42.397	0,85		
VEREINIGTE STAATEN					Summe Vereinigte Staaten		68.271	1,37			
USD	35.000	21st Century Fox America 4.75% 15/09/2044	38.665	0,77	Summe Anleihen		144.173	2,88			
USD	25.000	Amgen Inc. 4.66% 15/06/2051	26.863	0,54	Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					144.173	2,88
USD	30.000	Apple Inc. 1.30% 23/02/2018	30.108	0,60	Wert der Anlagen insgesamt					4.747.555	94,73
USD	20.000	Bae Systems Holdings 3.80% 07/10/2024	21.205	0,42	(Gesamtkosten: USD 4.746.803)						
USD	10.000	Duke Energy Progress 3.70% 15/10/2046	10.378	0,21							
USD	20.000	Emera US Finance LP 4.75% 15/06/2046	21.599	0,43							
USD	75.000	Erac USA Finance 3.30% 01/12/2026	77.561	1,55							
USD	100.000	Five Corners Funding P.P. 144A 4.42% 15/11/2023	107.932	2,15							

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen					Anleihen (Fortsetzung)				
KAIMANINSELN					SÜDKOREA				
USD	400.000	Baidu Inc. 4.13% 30/06/2025	429.090	1,01	USD	250.000	Busan Bank 3.63% 25/07/2026	252.583	0,59
USD	265.000	Champion 3.75% 17/01/2023	275.687	0,65	USD	300.000	Nonghyup Bank 1.88% 12/09/2021	298.812	0,70
USD	200.000	Emaar Sukuk 3.64% 31/12/2049	198.166	0,46			Summe Südkorea	551.395	1,29
USD	300.000	Emirates Islamic Bank Sukuk 3.54% 31/05/2021	307.184	0,72					
USD	500.000	Foxxconn Far East Limited 2.25% 23/09/2021	497.895	1,17	SINGAPUR				
USD	250.000	Tvb Finance Limited 3.63% 11/10/2021	250.654	0,59	USD	200.000	Theta Capital Pte Limited 7.00% 11/04/2022	211.131	0,49
USD	500.000	Yestar International Holding Company Limited 6.90% 14/09/2046	518.260	1,21			Summe Singapur	211.131	0,49
Summe Kaimaninseln			2.476.936	5,81	THAILAND				
					USD	470.000	Kasikornbank pcl 2.38% 06/04/2022	469.245	1,10
							Summe Thailand	469.245	1,10
CHINA					VEREINIGTE STAATEN				
USD	300.000	CQ Logistics 3.25% 06/09/2021	301.888	0,70	USD	476.000	Marquee Land Pte Limited 9.75% 05/08/2019	512.059	1,20
Summe China			301.888	0,70			Summe Vereinigte Staaten	512.059	1,20
INDONESIEN					BRITISCHE JUNGFERNINSELN				
USD	300.000	Perusahaan Gas Negara Persero Tbk PT 5.13% 16/05/2024	325.206	0,76	USD	300.000	China Railway XunJie Company Limited 3.25% 28/07/2026	301.151	0,71
USD	250.000	Perusahaan Listrik Negara Pt 5.25% 24/10/2042	257.893	0,60	USD	500.000	Cnooc Finance 2013 Limited 3.00% 09/05/2023	505.835	1,19
USD	300.000	Perusahaan Listrik Negara Pt 5.50% 22/11/2021	334.809	0,79	USD	500.000	NWD Finance (BVI) 5.75% 29/12/2049	507.148	1,19
Summe Indonesien			917.908	2,15	USD	600.000	Proven Honour Capital Limited 4.13% 06/05/2026	630.513	1,48
MALAYSIA					USD	250.000	Road King Infrastructure 5.00% 09/08/2019	255.259	0,60
USD	300.000	Axiata Bhd 4.36% 24/03/2026	331.164	0,78			Summe Britische Jungferninseln	2.199.906	5,17
USD	845.000	RHB Bank 2.50% 06/10/2021	846.486	1,98			Summe Anleihen	9.283.597	21,76
Summe Malaysia			1.177.650	2,76	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
MAURITIUS					INDONESIEN				
USD	200.000	HT Global It Solutions Holdings Limited 7.00% 14/07/2021	210.475	0,49	USD	300.000	Indonesia (Govt of) 3.38% 15/04/2023	310.302	0,73
Summe Mauritius			210.475	0,49	USD	400.000	Indonesia (Govt of) 3.75% 25/04/2022	421.924	0,99
PHILIPPINEN					USD	550.000	Indonesia (Govt of) 4.13% 15/01/2025	588.319	1,38
USD	250.000	Megaworld Corp. 4.25% 17/04/2023	255.004	0,60					
Summe Philippinen			255.004	0,60					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

				% des					% des
Nennwert	Anlage	Marktwert	USD	Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert	USD	Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				
INDONESIEN (Fortsetzung)					MONGOLEI				
USD	790.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 08/01/2026	884.945	2,07	USD	250.000	Mongolia (Govt of) 4.13% 05/01/2018	241.453	0,57
USD	200.000	Indonesia (Govt of) 4.88% 05/05/2021	220.235	0,52	USD	600.000	Mongolia (Govt of) 5.13% 05/12/2022	527.874	1,24
USD	500.000	Indonesia (Govt of) 5.13% 15/01/2045	570.608	1,34	Summe Mongolei			769.327	1,81
USD	700.000	Indonesia (Govt of) 5.25% 17/01/2042	802.518	1,88	PAKISTAN				
USD	400.000	Indonesia (Govt of) 5.88% 13/03/2020	447.682	1,05	USD	250.000	Pakistan (Govt of) 7.25% 15/04/2019	263.659	0,62
USD	700.000	Indonesia (Govt of) 5.95% 08/01/2046	888.838	2,08	USD	350.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 15/04/2024	384.827	0,90
USD	200.000	Indonesia (Govt of) 6.63% 17/02/2037	262.262	0,61	Summe Pakistan			648.486	1,52
IDR	8.000.000.000	Indonesia (Govt of) 7.00% 15/05/2022	618.596	1,45	PHILIPPINEN				
IDR	10.700.000.000	Indonesia (Govt of) 7.00% 15/05/2027	819.617	1,92	USD	1.300.000	Philippine (Govt of) 3.70% 01/03/2041	1.436.616	3,36
USD	300.000	Indonesia (Govt of) 7.75% 17/01/2038	434.306	1,02	USD	550.000	Philippine (Govt of) 3.95% 20/01/2040	629.280	1,47
IDR	3.000.000.000	Indonesia (Govt of) 7.88% 15/04/2019	236.975	0,56	USD	300.000	Philippine (Govt of) 4.20% 21/01/2024	342.011	0,80
IDR	3.400.000.000	Indonesia (Govt of) 8.25% 15/07/2021	275.664	0,65	USD	300.000	Philippine (Govt of) 5.50% 30/03/2026	379.052	0,89
IDR	10.500.000.000	Indonesia (Govt of) 8.25% 15/05/2036	876.953	2,06	USD	500.000	Philippine (Govt of) 6.38% 15/01/2032	707.888	1,66
IDR	4.900.000.000	Indonesia (Govt of) 8.38% 15/03/2024	405.616	0,95	USD	200.000	Philippine (Govt of) 6.38% 23/10/2034	291.072	0,68
IDR	6.771.000.000	Indonesia (Govt of) 8.38% 15/09/2026	568.388	1,33	USD	300.000	Philippine (Govt of) 7.75% 14/01/2031	468.308	1,10
IDR	3.400.000.000	Indonesia (Govt of) 8.38% 15/03/2034	284.949	0,67	USD	150.000	Philippines (Govt of) 9.88% 15/01/2019	178.536	0,42
IDR	6.500.000.000	Indonesia (Govt of) 8.75% 15/05/2031	564.084	1,32	USD	200.000	Power Sector Assets & Liabilities Management Corp. 7.39% 02/12/2024	272.867	0,64
IDR	1.400.000.000	Indonesia (Govt of) 9.00% 15/03/2029	122.850	0,29	Summe Philippinen			4.705.630	11,02
IDR	1.500.000.000	Indonesia (Govt of) 12.90% 15/06/2022	147.130	0,34	SÜDKOREA				
USD	500.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4.35% 10/09/2024	539.030	1,26	KRW	250.000.000	Korea (Govt of) 2.00% 10/03/2046	256.117	0,60
USD	850.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.55% 29/03/2026	923.214	2,16	KRW	300.000.000	Korea (Govt of) 2.25% 10/06/2025	290.990	0,68
					KRW	200.000.000	Korea (Govt of) 3.50% 10/03/2024	207.926	0,49
					KRW	300.000.000	Korea (Govt of) 3.75% 10/12/2033	367.165	0,86
		Summe Indonesien	12.215.005	28,63			Summe Südkorea	1.122.198	2,63

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	Nennwert	Anlage	
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (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						
SINGAPUR				MALAYSIA						
SGD	780.000	Singapore (Govt of) 2.25% 01/06/2021	596.855	1,40	MYR	1.100.000	Malaysia (Govt of) 3.66% 15/10/2020	270.482	0,63	
SGD	450.000	Singapore (Govt of) 2.25% 01/08/2036	337.636	0,79	MYR	900.000	Malaysia (Govt of) 3.80% 17/08/2023	222.507	0,52	
SGD	350.000	Singapore (Govt of) 2.38% 01/06/2025	270.050	0,63	MYR	1.000.000	Malaysia (Govt of) 3.90% 30/11/2026	249.011	0,58	
SGD	200.000	Singapore (Govt of) 2.75% 01/03/2046	166.783	0,39	MYR	1.000.000	Malaysia (Govt of) 3.96% 15/09/2025	246.923	0,58	
Summe Singapur			1.371.324	3,21	MYR	3.000.000	Malaysia (Govt of) 4.07% 30/09/2026	753.856	1,77	
SRI LANKA				MYR	500.000	Malaysia (Govt of) 4.23% 30/06/2031	125.333	0,29		
USD	200.000	Sri Lanka (Govt of) 5.75% 18/01/2022	204.966	0,48	MYR	500.000	Malaysia (Govt of) 4.50% 15/04/2030	127.553	0,30	
USD	400.000	Sri Lanka (Govt of) 6.25% 27/07/2021	419.238	0,98	MYR	700.000	Malaysia Investment 4.17% 30/04/2021	174.845	0,41	
USD	600.000	Sri Lanka (Govt of) 6.83% 18/07/2026	646.122	1,51	MYR	1.000.000	Malaysia Investment 4.25% 30/09/2030	248.896	0,58	
USD	600.000	Sri Lanka (Govt of) 6.85% 03/11/2025	645.165	1,51	MYR	3.500.000	Malaysia Investment 4.39% 07/07/2023	890.257	2,09	
Summe Sri Lanka			1.915.491	4,48	Summe Malaysia			3.309.663	7,75	
THAILAND				PHILIPPINEN						
THB	31.150.000	Thailand (Govt of) 2.13% 17/12/2026	900.882	2,12	PHP	9.600.000	Philippine (Govt of) 2.13% 23/05/2018	197.551	0,46	
THB	10.000.000	Thailand (Govt of) 2.55% 26/06/2020	297.736	0,70	PHP	20.000.000	Philippine (Govt of) 3.50% 21/04/2023	413.892	0,97	
THB	14.000.000	Thailand (Govt of) 3.63% 16/06/2023	447.131	1,05	PHP	24.000.000	Philippine (Govt of) 3.63% 09/09/2025	494.426	1,16	
THB	8.000.000	Thailand (Govt of) 3.65% 17/12/2021	252.156	0,59	PHP	3.350.000	Philippine (Govt of) 3.88% 22/11/2019	71.554	0,17	
THB	10.000.000	Thailand (Govt of) 3.85% 12/12/2025	331.661	0,78	PHP	15.000.000	Philippine (Govt of) 4.63% 09/09/2040	328.698	0,77	
Summe Thailand			2.229.566	5,24	Summe Philippinen			1.506.121	3,53	
VIETNAM				Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente						
USD	400.000	Vietnam (Govt of) 4.80% 19/11/2024	426.304	1,00				4.815.784	11,28	
Summe Vietnam			426.304	1,00	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt			4.815.784	11,28	
Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				25.403.331	59,54	Wert der Anlagen insgesamt			39.502.712	92,58
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				34.686.928	81,30	(Gesamtkosten: USD 38.601.659)				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen					Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				
BERMUDAS					MEXIKO				
USD	400.000	CBQ Finance Limited 3.38% 11/04/2017	404.040	0,48	MXN	550.000	Mexico (Govt of) Bonos 6.50% 09/06/2022	2.928.541	3,49
		Summe Bermudas	404.040	0,48	MXN	100.000	Mexico (Govt of) Bonos 7.25% 15/12/2016	519.126	0,62
KAIMANINSELN					MXN	280.000	Mexico (Govt of) Bonos 7.50% 03/06/2027	1.596.246	1,90
USD	300.000	Hutchison Whampoa International 11 Limited 3.50% 13/01/2017	301.854	0,36	MXN	683.000	Mexico (Govt of) Bonos 8.00% 07/12/2023	3.963.806	4,72
		Summe Kaimaninseln	301.854	0,36			Summe Mexiko	9.007.719	10,73
DEUTSCHLAND					Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
USD	500.000	Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank 1.63% 25/04/2017	502.123	0,60				15.805.939	18,82
		Summe Deutschland	502.123	0,60	Aktien				
VEREINIGTE STAATEN					BELGIEN				
USD	200.000	Kellogg Company 1.75% 17/05/2017	200.749	0,24		5.432	Anheuser-Busch InBev NV	711.783	0,84
		Summe Vereinigte Staaten	200.749	0,24			Summe Belgien	711.783	0,84
Summe Anleihen					BERMUDAS				
			1.408.766	1,68		19.254	IHS Markit Limited	722.988	0,86
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente							Summe Bermudas	722.988	0,86
AUSTRALIEN					BRASILIEN				
AUD	2.300.000	Australia (Govt of) 2.75% 21/04/2024	1.874.181	2,23		48.200	Kroton Educacional SA	219.425	0,26
AUD	2.000.000	Australia (Govt of) 3.25% 21/04/2029	1.721.629	2,05			Summe Brasilien	219.425	0,26
AUD	1.500.000	New South Wales Treasury Corp. 3.50% 20/03/2019	1.197.864	1,42	KANADA				
AUD	1.300.000	New South Wales Treasury Corp. 6.00% 01/04/2019	1.101.918	1,31		18.469	Suncor Energy Inc.	513.069	0,61
		Summe Australien	5.895.592	7,01			Summe Kanada	513.069	0,61
KANADA					KAIMANINSELN				
USD	500.000	Ontario (Province of) 1.10% 25/10/2017	500.938	0,60		5.232	Alibaba Group Holding	553.493	0,66
		Summe Kanada	500.938	0,60		32.100	Tencent Holdings Limited	881.554	1,04
							Summe Kaimaninseln	1.435.047	1,70
FINNLAND					CHINA				
USD	400.000	Municipality Finance plc 1.63% 25/04/2017	401.690	0,48		91.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	471.663	0,56
		Summe Finnland	401.690	0,48		49.200	Sinopharm Group Company	236.296	0,28
							Summe China	707.959	0,84

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
DÄNEMARK				MEXIKO			
12.256	Novo Nordisk A/S	509.407	0,61	6.621	Fomento Economico Mexicano SA de CV - ADR	609.397	0,73
	Summe Dänemark	509.407	0,61	84.600	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	444.472	0,53
FRANKREICH				Summe Mexiko		1.053.869	1,26
8.560	Criteo SA - ADR	300.542	0,36	NIEDERLANDE			
	Summe Frankreich	300.542	0,36	1.866	ASML Holding NV	204.857	0,24
DEUTSCHLAND				22.326	Reed Elsevier NV	401.314	0,48
9.839	Brenntag AG	537.429	0,64	Summe Niederlande		606.171	0,72
28.377	Deutsche Telekom AG - Reg	475.800	0,57	SÜDKOREA			
	Summe Deutschland	1.013.229	1,21	311	Samsung Electronics Company Limited	451.246	0,54
HONGKONG				Summe Südkorea		451.246	0,54
63.200	Aia Group Limited	420.059	0,50	SPANIEN			
	Summe Hongkong	420.059	0,50	19.346	Cellnex Telecom SAU	350.031	0,42
INDIEN				17.981	Inditex SA	666.832	0,80
6.333	HDFC Bank Limited - ADR	455.279	0,54	Summe Spanien		1.016.863	1,22
	Summe Indien	455.279	0,54	SCHWEIZ			
INDONESIEN				7.170	Novartis AG - Reg	565.079	0,67
797.300	Bank Rakyat Indonesia	745.286	0,88	6.487	Tyco Electronics Limited	417.633	0,50
	Summe Indonesien	745.286	0,88	35.185	UBS Group	480.191	0,57
IRLAND				Summe Schweiz		1.462.903	1,74
6.203	Alkermes plc	291.727	0,35	VEREINIGTES KÖNIGREICH			
2.006.387	Bank of Ireland	419.389	0,50	8.216	Aon Corp.	924.217	1,10
13.475	CRH plc	450.738	0,54	80.110	BT Group plc	404.857	0,48
5.473	Willis Towers Watson plc	726.650	0,87	15.688	Diageo plc	450.471	0,54
	Summe Irland	1.888.504	2,26	10.397	Nielsen Holdings plc	556.967	0,66
JAPAN				15.640	Royal Dutch Shell plc - A	389.665	0,46
12.000	Mitsui Fudosan Company Limited	253.059	0,30	21.347	Unilever plc	1.013.384	1,21
3.000	Nintendo Company Limited	788.180	0,94	Summe Vereinigtes Königreich		3.739.561	4,45
34.300	Sekisui Chemical Company Limited	489.444	0,58	VEREINIGTE STAATEN			
30.300	Yaskawa Electric Corp.	448.224	0,53	18.810	Activision Blizzard Inc.	833.283	0,99
	Summe Japan	1.978.907	2,35	5.136	Align Technology Inc.	481.500	0,57
JERSEY - KANALINSELN				1.591	Alphabet Inc. - A	1.279.259	1,52
9.535	Wolseley plc	539.409	0,64	572	Alphabet Inc. - C	444.610	0,53
	Summe Jersey - Kanalinseln	539.409	0,64	1.555	Amazon.com Inc.	1.302.016	1,54
				6.377	Amphenol Corp.	413.995	0,49
				15.512	BB&T Corp.	585.113	0,70

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

		% des				% des		
Nennwert	Anlage	Marktwert USD	Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	Netto- vermögens	
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt				
Aktien (Fortsetzung)				Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				ISRAEL				
10.246	Bristol-Myers Squibb Company	552.464	0,66	USD	725.000	Israel (Govt of) AID Bond 5.50% 04/12/2023	909.641	1,08
9.391	Charles Schwab Corp.	296.474	0,35			Summe Israel	909.641	1,08
10.386	Comcast Corp.	689.007	0,82	VEREINIGTE STAATEN				
7.657	Dentsply Sirona Inc.	455.056	0,54	USD	4.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 27/10/2016	3.999.500	4,76
16.911	Enterprise Products Partners LP	467.251	0,56	USD	5.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 25/11/2016	4.998.951	5,96
6.440	Estee Lauder Companies Inc.	570.326	0,68			Summe Vereinigte Staaten	8.998.451	10,72
6.320	Facebook Inc. - A	810.666	0,97	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
9.714	Gilead Sciences Inc.	768.571	0,92			9.908.092	11,80	
2.374	Graco Inc.	175.676	0,21	Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt				
9.277	JPMorgan Chase & Company	617.755	0,73			9.908.092	11,80	
7.506	Mastercard Inc. - A	763.885	0,91	Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren				
10.472	Nike Inc.	551.351	0,66	Fonds				
7.152	Occidental Petroleum Corp.	521.524	0,63	LUXEMBURG				
27.802	Pfizer Inc.	941.655	1,11	298.618	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio	4.416.553	5,26	
234	Priceline.Com Inc.	344.329	0,41			Summe Luxemburg	4.416.553	5,26
17.794	Sabre Corp.	501.435	0,60	VEREINIGTES KÖNIGREICH				
997	Sherwin-Williams Company	275.830	0,33	2.942.574	Threadneedle Investment Funds ICVC - European High Yield Bond Fund	3.776.558	4,50	
9.063	Spirit Airlines Inc.	385.449	0,46			Summe Vereinigtes Königreich	3.776.558	4,50
3.510	Stryker Corp.	408.599	0,49			Summe Fonds	8.193.111	9,76
4.842	Tjx Companies Inc.	362.085	0,43	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren				
7.164	Union Pacific Corp.	698.705	0,83			8.193.111	9,76	
5.129	United Parcel Service Inc.	560.907	0,67	Wert der Anlagen insgesamt				
5.899	Vertex Pharmaceuticals Inc.	514.452	0,61			75.279.061	89,63	
10.130	Visa Inc. - A	837.751	1,00	(Gesamtkosten: USD 75.384.482)				
3.890	Zimmer Holdings Inc.	505.778	0,60					
Summe Vereinigte Staaten		18.916.757	22,52					
Summe Aktien		39.408.263	46,91					
Strukturierte Instrumente - Rohstoffe								
IRLAND								
4.290	Source Physical Gold ETC 0.00%	554.890	0,66					
Summe Irland		554.890	0,66					
Summe Strukturierte Instrumente - Rohstoffe		554.890	0,66					
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind								
		57.177.858	68,07					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

				Marktwert	% des			Marktwert	% des	
Nennwert	Anlage			USD	Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	USD	Netto- vermögens	
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind						Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen						Anleihen (Fortsetzung)				
AUSTRALIEN						FRANKREICH (Fortsetzung)				
USD	26.000	Origin Energy Finance 5.45% 14/10/2021		28.038	0,05	EUR	100.000	Rexel SA 3.25% 15/06/2022	115.522	0,19
EUR	100.000	Origin Energy Finance Limited 2.50% 23/10/2020		118.905	0,20	EUR	100.000	Rexel SA 3.50% 15/06/2023	115.565	0,19
		Summe Australien		146.943	0,25	EUR	200.000	Solvay Finance SA FRN 29/06/2049	238.860	0,39
ÖSTERREICH						EUR	200.000	Spcm SA 2.88% 15/06/2023	225.293	0,37
EUR	275.000	Hypo Alpe-Adria International 4.25% 31/10/2016		274.761	0,45	EUR	100.000	Total SA FRN 29/12/2049	119.507	0,20
		Summe Österreich		274.761	0,45	GBP	100.000	Veolia Environment SA 4.85% 29/01/2049	134.388	0,21
BELGIEN							Summe Frankreich	2.810.260	4,58	
EUR	100.000	KBC Groep NV FRN 19/12/2049		109.983	0,18	DEUTSCHLAND				
		Summe Belgien		109.983	0,18	EUR	120.000	Ceramtec Group GmbH 8.25% 15/08/2021	143.248	0,23
KANADA						EUR	65.000	Heidelbergcement AG 2.25% 03/06/2024	77.088	0,13
EUR	110.000	Cott Finance Corp. 5.50% 01/07/2024		130.211	0,21	EUR	170.000	Heidelbergcement Finance 7.50% 03/04/2020	234.940	0,39
EUR	140.000	Valeant Pharmaceuticals International Inc. 4.50% 15/05/2023		125.524	0,21	EUR	200.000	Progroup AG 5.13% 01/05/2022	240.265	0,40
		Summe Kanada		255.735	0,42	EUR	100.000	Safari Holding Verwaltungs GmbH 8.25% 15/02/2021	118.661	0,20
KAIMANINSELN						EUR	109.000	Schaeffler 2.75% 15/09/2021	122.792	0,20
GBP	100.000	Petrobras International Finance Company 6.25% 14/12/2026		121.684	0,20	EUR	100.000	Schaeffler 3.25% 15/09/2023	112.339	0,18
EUR	100.000	Viridian Group 7.50% 01/03/2020		119.193	0,20	EUR	110.000	Schaeffler 3.75% 15/09/2026	123.458	0,20
		Summe Kaimaninseln		240.877	0,40	EUR	200.000	Techem Energy Metering Service GmbH & Company 7.88% 01/10/2020	235.344	0,39
FRANKREICH						EUR	265.000	Thyssenkrupp AG 2.75% 08/03/2021	313.031	0,51
EUR	150.000	Areva SA 4.88% 23/09/2024		171.567	0,28	EUR	160.000	Trionista Holdco GmbH 5.00% 30/04/2020	185.002	0,30
EUR	100.000	Crown Euro Holdings 2.63% 30/09/2024		111.215	0,18	EUR	100.000	Unitymedia Hessen GmbH 3.50% 15/01/2027	111.157	0,18
EUR	200.000	Crown European Holdings SA 4.00% 15/07/2022		245.921	0,40	EUR	100.000	Wepa Hygieneprodukte GmbH 3.75% 15/05/2024	116.576	0,19
EUR	210.000	Ephios Bondco plc 6.25% 01/07/2022		251.062	0,41		Summe Deutschland	2.133.901	3,50	
EUR	200.000	Horizon Holdings III 5.13% 01/08/2022		236.839	0,39	UNGARN				
EUR	150.000	Novalis SAS 3.00% 30/04/2022		170.252	0,28	EUR	110.000	Mol Hungarian Oil 2.63% 28/04/2023	129.171	0,21
EUR	325.000	Numericable Group SA 5.38% 15/05/2022		378.214	0,61		Summe Ungarn	129.171	0,21	
EUR	146.000	Orange SA FRN 29/10/2049		178.434	0,29	IRLAND				
EUR	100.000	Paprec Holding 5.25% 01/04/2022		117.621	0,19	EUR	100.000	Allied Irish Banks FRN 26/11/2025	108.616	0,18
						EUR	100.000	Ardagh Packaging Finance 6.75% 15/05/2024	118.162	0,20
						EUR	200.000	Ardagh Packaging Finance plc 4.25% 15/01/2022	230.186	0,38

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

		% des				% des			
Nennwert	Anlage	Marktwert USD	Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	Netto- vermögens		
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					
Anleihen (Fortsetzung)				Anleihen (Fortsetzung)					
IRLAND (Fortsetzung)				LUXEMBURG (Fortsetzung)					
EUR	200.000	Bank of Ireland FRN 29/12/2049	215.268	0,36	EUR	100.000	Cirsa Funding Luxembourg SA 5.88% 15/05/2023	117.354	0,19
EUR	175.000	Eircom Fianance 4.50% 31/05/2022	200.443	0,33	USD	225.000	Codere Finance 2 Luxembourg 9.00% 30/06/2021	231.438	0,38
GBP	100.000	Virgin Media Receivables Financing Note 5.50% 15/09/2024	129.966	0,21	EUR	200.000	Dufry Finance SCA 4.50% 01/08/2023	237.166	0,39
Summe Irland		1.002.641	1,66	EUR	200.000	Fiat Finance & Trade SA 4.75% 22/03/2021	245.896	0,41	
				EUR	100.000	Fiat Finance & Trade SA 6.75% 14/10/2019	127.740	0,21	
ITALIEN				EUR	200.000	Finmec Finance SA 4.50% 19/01/2021	252.502	0,42	
EUR	200.000	Enel SpA FRN 15/01/2075	239.735	0,39	GBP	100.000	Garfunkelux Holdco 8.50% 01/11/2022	133.234	0,22
EUR	100.000	Lkq Italia Bondco 3.88% 01/04/2024	120.140	0,20	EUR	100.000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.50% 01/08/2022	115.793	0,19
EUR	100.000	Telecom Italia SpA 3.00% 30/09/2025	112.472	0,18	EUR	200.000	Gazprom OAO 4.63% 15/10/2018	238.165	0,39
EUR	100.000	Telecom Italia SpA 3.63% 19/01/2024	119.441	0,20	USD	450.000	Gazprom OAO via Gaz Capital SA 6.00% 23/01/2021	489.537	0,81
EUR	100.000	Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	116.911	0,19	EUR	100.000	Gestamp Fund Lux 3.50% 15/05/2023	116.112	0,19
EUR	100.000	Telecom Italia SpA 4.50% 25/01/2021	126.203	0,21	EUR	200.000	Grand City Properties SA FRN 29/12/2049	230.597	0,38
Summe Italien		834.902	1,37	EUR	100.000	Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	116.946	0,19	
				EUR	100.000	Intralot Capital Lux 6.75% 15/09/2021	113.182	0,19	
JAPAN				EUR	250.000	Matterhorn Telecom SA 3.88% 01/05/2022	280.736	0,45	
EUR	100.000	Softbank Group Corp 4.00% 30/07/2022	121.677	0,20	EUR	200.000	Play Topco SA 7.75% 28/02/2020	229.743	0,38
EUR	205.000	Softbank Group Corp 4.75% 30/07/2025	253.750	0,42	EUR	200.000	Swissport Investments Sa 6.75% 15/12/2021	232.827	0,38
Summe Japan		375.427	0,62	EUR	19.000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	28.578	0,05	
JERSEY - KANALINSELN				EUR	219.000	Telenet Finance VI 4.88% 15/07/2027	259.541	0,42	
GBP	200.000	Cpuk Finance Limited 7.00% 28/02/2042	275.292	0,45	EUR	190.000	Wind Acquisition Finance SA 7.00% 23/04/2021	223.754	0,37
EUR	100.000	Lincoln Finance Limited 6.88% 15/04/2021	121.761	0,20	Summe Luxemburg		4.724.786	7,77	
EUR	100.000	Mercury Bondco 8.25% 30/05/2021	117.068	0,19	NIEDERLANDE				
GBP	100.000	Tvl Finance plc 8.50% 15/05/2023	137.045	0,23	EUR	200.000	Adria Bidco BV 7.88% 15/11/2020	235.185	0,39
Summe Jersey - Kanalinseln		651.166	1,07	EUR	150.000	Carlson Wagonlit BV 7.50% 15/06/2019	176.042	0,29	
LUXEMBURG				GBP	100.000	Intergen NV 7.50% 30/06/2021	109.116	0,18	
EUR	100.000	Altice SA 6.25% 15/02/2025	113.251	0,19	EUR	100.000	Interxion Holding 6.00% 15/07/2020	118.159	0,19
EUR	300.000	Altice SA 7.25% 15/05/2022	356.290	0,59					
EUR	100.000	Cerberus Nightingale 1 sarl 8.25% 01/02/2020	115.939	0,19					
EUR	100.000	Cirsa Funding Lux 5.75% 15/05/2021	118.465	0,19					

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Anleihen (Fortsetzung)				
NIEDERLANDE (Fortsetzung)					SCHWEDEN				
EUR	100.000	Koninklijke Kpn NV FRN 14/03/2049	121.010	0,20	EUR	100.000	Volvo Treasury AB FRN 10/06/2075	116.544	0,19
EUR	104.000	LGE Holdco VI BV 7.13% 15/05/2024	130.674	0,22			Summe Schweden	116.544	0,19
EUR	150.000	Oi European Group BV 6.75% 15/09/2020	202.900	0,33	SCHWEIZ				
EUR	100.000	Petrobras Global Finance BV 4.75% 14/01/2025	104.521	0,17	EUR	290.000	Credit Suisse AG FRN 18/09/2025	354.954	0,59
EUR	230.000	Schaeffler Holding Finance BV 3.25% 15/05/2019	263.042	0,43	EUR	100.000	UBS AG FRN 12/02/2026	120.125	0,20
EUR	60.000	Schaeffler Holding Finance BV 5.75% 15/11/2021	73.633	0,12	EUR	200.000	UBS Group FRN 29/12/2049	232.630	0,38
EUR	140.625	Schaeffler Holding Finance BV 6.88% 15/08/2018	161.102	0,27			Summe Schweiz	707.709	1,17
EUR	100.000	SNS Bank NV FRN 05/11/2025	114.715	0,19	VEREINIGTES KÖNIGREICH				
EUR	200.000	Telefonica Europe 3.75% 15/09/2026	224.042	0,38	GBP	200.000	Anglian Water (Osprey) Financing plc 7.00% 31/01/2018	280.119	0,47
GBP	400.000	Telefonica Europe BV FRN 26/11/2049	557.261	0,91	EUR	100.000	Anglo American Capital plc 1.50% 01/04/2020	110.335	0,18
CHF	179.000	UPC Holding BV 6.75% 15/03/2023	199.568	0,33	EUR	105.000	Anglo American Capital plc 2.75% 07/06/2019	122.077	0,20
EUR	200.000	Ziggo Bond Finance BV FRN 15/01/2025	225.495	0,37	EUR	210.000	Anglo American Capital plc 3.50% 28/03/2022	242.169	0,40
Summe Niederlande			3.016.465	4,97	GBP	131.086	Annington Finance 13.00% 15/01/2023	195.255	0,33
NORWEGEN					GBP	100.000	Arrow Global Finance 5.13% 15/09/2024	126.334	0,21
EUR	100.000	Lock AS 7.00% 15/08/2021	117.629	0,19	GBP	125.000	Barclays Bank plc FRN 29/11/2049	203.837	0,34
Summe Norwegen			117.629	0,19	GBP	100.000	Boparan Finance plc 5.50% 15/07/2021	120.654	0,20
PORTUGAL					GBP	100.000	Cognita Financing plc 7.75% 15/08/2021	136.119	0,23
EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2019	25.847	0,04	GBP	100.000	Company-Operative Bank plc 5.13% 20/09/2017	123.261	0,20
Summe Portugal			25.847	0,04	GBP	200.000	Co-operative Group 6.88% 08/07/2020	300.672	0,49
RUSSISCHE FÖDERATION					GBP	100.000	Debehams plc 5.25% 15/07/2021	132.498	0,22
EUR	100.000	Gazprom (Gaz Capital) 3.39% 20/03/2020	117.003	0,19	EUR	100.000	EC Finance plc 5.13% 15/07/2021	116.732	0,19
Summe Russische Föderation			117.003	0,19	GBP	100.000	Enterprise Inns 6.50% 06/12/2018	140.591	0,23
SPANIEN					GBP	70.000	First Hydro Finance plc 9.00% 31/07/2021	121.409	0,20
EUR	100.000	NH Hotel Group SA 6.88% 15/11/2019	123.010	0,20	GBP	100.000	Idh Finance plc 6.25% 15/08/2022	126.874	0,21
Summe Spanien			123.010	0,20	EUR	150.000	Ineos Finance plc 4.00% 01/05/2023	169.607	0,28
					EUR	100.000	Inovyn Finance plc 6.25% 15/05/2021	116.692	0,19

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

				% des					% des
Nennwert	Anlage	Marktwert	USD	Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert	USD	Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Anleihen (Fortsetzung)				
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)					VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)				
EUR	100.000	International Game Technology 4.13% 15/02/2020	119.966	0,20	CHF	150.000	Nord Anglia Education Finance LLC 5.75% 15/07/2022	162.472	0,27
EUR	150.000	International Personal Finance plc 5.75% 07/04/2021	148.734	0,24	EUR	200.000	Sealed Air Corp 4.50% 15/09/2023	248.474	0,41
GBP	100.000	Jaguar Land Rover 3.88% 01/03/2023	134.897	0,22	Summe Vereinigte Staaten			1.220.920	2,01
GBP	200.000	Jerrold Finco plc 9.75% 15/09/2018	273.517	0,45	Summe Anleihen			25.337.905	41,65
GBP	100.000	Keystone Financing 9.50% 15/10/2019	135.746	0,22	Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen				
EUR	250.000	Merlin Entertainments plc 2.75% 15/03/2022	289.615	0,47	DEUTSCHLAND				
GBP	100.000	Moy Park Bondco plc 6.25% 29/05/2021	135.577	0,23	EUR	182.250	Unitymedia Hessen 5.75% 15/01/2023	217.496	0,36
GBP	100.000	New Look Secured Issuer plc 6.50% 01/07/2022	120.533	0,20	EUR	182.250	Unitymedia Hessen Gmbh & Company 5.13% 21/01/2023	215.595	0,35
USD	100.000	Royal Bank of Scotland 6.13% 15/12/2022	106.172	0,17	Summe Deutschland			433.091	0,71
USD	240.000	Royal Bank of Scotland 8.63% 29/12/2049	237.731	0,39	SCHWEDEN				
GBP	100.000	Southern Water (Greensands) plc 8.50% 15/04/2019	148.196	0,24	EUR	70.000	TVN Finance Corp. 7.38% 15/12/2020	82.708	0,14
GBP	200.000	Tesco plc 6.13% 24/02/2022	297.544	0,49	Summe Schweden			82.708	0,14
GBP	125.000	Thames Water Kemble Finance plc 7.75% 01/04/2019	184.041	0,30	VEREINIGTES KÖNIGREICH				
GBP	100.000	Travis Perkins 4.50% 07/09/2023	132.210	0,22	GBP	157.500	Virgin Media Secured Finance plc 5.50% 15/01/2025	211.794	0,35
GBP	100.000	Twinkle Pizza plc 6.63% 01/08/2021	127.529	0,21	Summe Vereinigtes Königreich			211.794	0,35
GBP	250.000	Virgin Media Finance 6.38% 15/10/2024	339.267	0,56	Summe Forderungs- und hypothekenbesicherte Wertpapiere			727.593	1,20
EUR	100.000	Virgin Media Finance plc 4.50% 15/01/2025	111.738	0,18	Aktien				
GBP	200.000	William Hill plc 4.88% 07/09/2023	273.977	0,45	AUSTRALIEN				
Summe Vereinigtes Königreich			6.202.225	10,21		34.183	Amcor Limited	396.302	0,65
						71.466	AMP Limited	288.760	0,48
						33.763	Challenger Financial Services Group Limited	262.764	0,43
						63.071	Dulux Group Limited	318.550	0,52
						81.232	Goodman Group	452.545	0,74
						74.902	Sydney Airport	399.512	0,65
					Summe Australien			2.118.433	3,47
VEREINIGTE STAATEN					BRASILIEN				
EUR	100.000	Axalta Coating System 4.25% 15/08/2024	115.787	0,19	55.100	Ambev SA	336.144	0,55	
EUR	200.000	Ball Corp. 4.38% 15/12/2023	251.760	0,42	52.500	Kroton Educacional SA	239.000	0,39	
EUR	180.000	Ims Health Inc. 3.50% 15/10/2024	206.252	0,34	Summe Brasilien			575.144	0,94
EUR	100.000	Kloeckner Pentaplast of America Inc. 7.13% 01/11/2020	118.529	0,19					
EUR	100.000	Mpt Operating Partnership 5.75% 01/10/2020	117.646	0,19					

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
KANADA				NORWEGEN			
3.388	Agrium Inc.	307.258	0,51	17.791	Telenor ASA	305.186	0,50
6.800	Davis + Henderson Corp.	146.736	0,24		Summe Norwegen	305.186	0,50
8.800	National Bank of Canada	311.490	0,51				
16.700	Suncor Energy Inc.	462.784	0,76				
8.100	Transcanada Corp.	384.030	0,63				
	Summe Kanada	1.612.298	2,65				
KAIMANINSELN				SÜDAFRIKA			
307.000	HKT Trust and Hkt Limited	432.240	0,71	9.682	Spar Group Limited	135.339	0,22
	Summe Kaimaninseln	432.240	0,71		Summe Südafrika	135.339	0,22
FINNLAND				SPANIEN			
5.667	Sampo OYJ - A	252.196	0,41	12.209	Ferrovial SA	260.003	0,43
	Summe Finnland	252.196	0,41		Summe Spanien	260.003	0,43
DEUTSCHLAND				SCHWEIZ			
4.945	BASF SE	422.958	0,70	8.609	Novartis AG - Reg	678.489	1,11
3.886	Daimler AG - Reg	273.860	0,45	20.066	UBS Group	273.853	0,45
25.182	Deutsche Telekom AG - Reg	422.229	0,69		Summe Schweiz	952.342	1,56
8.126	Prosiebensat.1 Media AG Pfd	348.112	0,57				
	Summe Deutschland	1.467.159	2,41				
JAPAN				TAIWAN			
92.000	Aozora Bank Limited	315.252	0,52	26.000	Advanced Semiconductor Engineering Inc.	31.188	0,05
5.900	Canon Inc.	170.332	0,28	171.000	Pegatron Corp.	439.706	0,72
2.700	Itochu Techno-Solutions Corp.	69.003	0,11	92.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	535.652	0,88
309	Japan Hotel Reit Investment	245.027	0,40		Summe Taiwan	1.006.546	1,65
118	Japan Retail Fund Investment Corp.	291.431	0,48				
	Summe Japan	1.091.045	1,79				
MEXIKO				VEREINIGTES KÖNIGREICH			
186.800	Kimberly-Clark de Mexico SA de CV	423.335	0,70	8.104	Astrazeneca plc	526.776	0,87
181.500	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	399.320	0,66	66.892	BAE Systems plc	455.318	0,75
	Summe Mexiko	822.655	1,36	9.164	British American Tobacco plc	586.869	0,96
NIEDERLANDE				86.793	BT Group plc	438.631	0,73
5.832	Lyondellbasell Industries NV - A	470.408	0,77	16.467	Glaxosmithkline plc	351.448	0,58
14.020	Unilever NV	647.164	1,06	49.218	HSBC Holdings plc	369.987	0,61
	Summe Niederlande	1.117.572	1,83	14.847	Intermediate Capital Group plc	113.789	0,19
				68.685	Legal & General Group plc	195.128	0,32
				23.813	National Grid plc	337.789	0,56
				5.941	Rio Tinto plc	198.683	0,33
				31.727	Royal Dutch Shell plc - A	788.824	1,29
				25.363	St James's Place plc	312.332	0,52
					Summe Vereinigtes Königreich	4.675.574	7,71

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt			
Aktien (Fortsetzung)				Anleihen			
VEREINIGTE STAATEN				VEREINIGTE STAATEN			
5.504	AbbVie Inc.	347.137	0,57	USD	200.000 Neptune Finco Corp. P.P. 144A 10.88% 15/10/2025	234.680	0,39
34.583	AES Corp.	444.392	0,73				
5.763	Altria Group Inc.	364.394	0,60		Summe Vereinigte Staaten	234.680	0,39
23.109	Ares Capital Corp.	358.190	0,59				
14.818	BB&T Corp.	558.935	0,92		Summe Anleihen	234.680	0,39
10.901	Blackstone Group LP	278.303	0,46				
27.921	Cisco Systems Inc.	885.654	1,46		Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt	234.680	0,39
6.194	CME Group Inc.	647.396	1,06				
10.046	Coca Cola Company	425.147	0,70				
5.836	Crown Castle International Corp.	549.809	0,91				
21.587	Cypress Semiconductor Corp.	262.498	0,43		Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		
7.432	Dow Chemical Company	385.201	0,63		Anleihen		
21.138	Enterprise Products Partners LP	584.043	0,96				
13.918	General Electric Company	412.251	0,68		VEREINIGTES KÖNIGREICH		
17.392	General Motors Company	552.544	0,91		GBP	100.000 Iron Mountain Europe plc 6.13% 15/09/2022	137.626 0,23
9.027	JPMorgan Chase & Company	601.108	0,99			Summe Vereinigtes Königreich	137.626 0,23
8.152	Las Vegas Sands Corp.	469.066	0,77				
8.755	Limited Brands Inc.	619.591	1,02		Summe Anleihen	137.626	0,23
7.868	Maxim Integrated Products Inc.	314.169	0,52				
8.042	Merck & Company Inc.	501.901	0,83		Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	137.626	0,23
6.303	Occidental Petroleum Corp.	459.615	0,76				
8.628	Outfront Media Inc.	204.052	0,34		Wert der Anlagen insgesamt	57.510.609	94,56
12.479	Pattern Energy Group Inc.	280.653	0,46				
23.735	Pfizer Inc.	803.904	1,31		(Gesamtkosten: USD 57.363.899)		
3.763	Philip Morris International Inc.	365.839	0,60				
21.216	Regal Entertainment Group	461.448	0,76				
17.032	Reynolds American Inc.	803.059	1,33				
9.527	Six Flags Entertainment Corp.	510.743	0,84				
22.155	Starwood Property Trust Inc.	498.931	0,82				
2.735	United Parcel Service Inc.	299.100	0,49				
	Summe Vereinigte Staaten	14.249.073	23,45				
	Summe Aktien	31.072.805	51,09				
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	57.138.303	93,94				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Focus

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BELGIEN				VEREINIGTES KÖNIGREICH			
21.393	Anheuser-Busch InBev NV	2.803.233	1,97	25.470	Aon Corp.	2.865.120	2,01
	Summe Belgien	2.803.233	1,97	176.286	Berendsen plc	2.848.704	2,00
KAIMANINSELN				90.221	British American Tobacco plc	5.777.816	4,07
13.266	Alibaba Group Holding	1.403.410	0,99	53.281	Nielsen Holdings plc	2.854.263	2,01
127.700	Tencent Holdings Limited	3.506.990	2,47	54.358	Reckitt Benckiser Group plc	5.129.892	3,61
	Summe Kaimaninseln	4.910.400	3,46		Summe Vereinigtes Königreich	19.475.795	13,70
DÄNEMARK				VEREINIGTE STAATEN			
64.476	Novo Nordisk A/S	2.679.875	1,88	63.209	Activision Blizzard Inc.	2.800.159	1,97
	Summe Dänemark	2.679.875	1,88	6.976	Alphabet Inc. - A	5.609.123	3,94
DEUTSCHLAND				5.944	Amazon.com Inc.	4.976.971	3,49
10.701	Continental AG	2.250.625	1,58	46.615	Charles Schwab Corp.	1.471.636	1,03
	Summe Deutschland	2.250.625	1,58	38.569	Colgate-Palmolive Company	2.859.506	2,01
HONGKONG				42.658	Comcast Corp.	2.829.932	1,99
1.031.000	Aia Group Limited	6.852.538	4,82	15.981	Cooper Companies Inc.	2.864.754	2,01
	Summe Hongkong	6.852.538	4,82	9.603	Costco Wholesale Corp.	1.464.554	1,03
INDIEN				48.059	Dentsply Sirona Inc.	2.856.146	2,01
136.912	Asian Paints Limited	2.386.885	1,68	19.659	Equifax Inc.	2.645.708	1,86
260.150	Hdfc Bank Limited	5.729.694	4,03	32.091	Estee Lauder Companies Inc.	2.841.979	2,00
	Summe Indien	8.116.579	5,71	67.895	Mastercard Inc. - A	6.909.674	4,86
IRLAND				68.543	Nike Inc.	3.608.789	2,54
33.235	Medtronic Inc.	2.871.504	2,02	55.002	Ppg Industries Inc.	5.685.006	3,99
	Summe Irland	2.871.504	2,02	74.937	Reynolds American Inc.	3.533.280	2,48
JAPAN				37.304	S&P Global Inc.	4.721.194	3,32
4.028	Keyence Corp.	2.922.005	2,05	35.721	Thermo Fisher Scientific Inc.	5.681.783	4,00
11.900	Shimano Inc.	1.753.301	1,23	31.720	Tjx Companies Inc.	2.372.021	1,67
	Summe Japan	4.675.306	3,28	26.021	Union Pacific Corp.	2.537.828	1,78
NIEDERLANDE				72.740	Visa Inc. - A	6.015.598	4,23
319.853	Reed Elsevier NV	5.749.416	4,04		Summe Vereinigte Staaten	74.285.641	52,21
124.646	Unilever NV	5.753.670	4,04		Summe Aktien	140.424.582	98,71
	Summe Niederlande	11.503.086	8,08		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	140.424.582	98,71
					Wert der Anlagen insgesamt	140.424.582	98,71
					(Gesamtkosten: USD 132.150.363)		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
ARGENTINIEN				INDIEN			
1.121	Pampa Energia Sa - ADR	36.320	0,81	2.124	Apollo Hospitals Enterprise Limited	41.901	0,93
	Summe Argentinien	36.320	0,81	24.602	Dish TV India Limited	34.403	0,77
BRASILIEN				1.264	Dr Reddy's Laboratories Limited - ADR	58.675	1,31
15.263	Alpargatas SA	45.382	1,01	2.439	Godrej Consumer Products Limited	58.125	1,29
8.961	Ambev SA - ADR	54.572	1,21	1.670	HDFC Bank Limited - ADR	120.055	2,68
10.200	BM&F Bovespa SA	52.776	1,18	1.017	Hero Honda Motors Limited	52.145	1,16
5.230	CPFL Energia SA	38.941	0,87	2.883	Infosys Technologies Limited - ADR	45.494	1,01
2.300	Energisa SA	14.683	0,33	2.282	Larsen & Toubro Limited - GDR	48.834	1,08
6.900	Klabin SA	36.190	0,81	464	Ultra Tech Cement Limited	26.843	0,60
1.200	Linx SA	7.166	0,16		Summe Indien	486.475	10,83
4.905	Telecomunicacoes de Sao Paulo SA - ADR	70.976	1,58				
	Summe Brasilien	320.686	7,15				
KAIMANINSELN				INDONESIEN			
3.000	AAC Acoustic Technologies Holdings Inc.	30.151	0,67	91.400	Astra International Tbk PT	57.775	1,28
797	Alibaba Group Holding	84.315	1,88	33.500	Matahari Department Store Tbk Pt	47.421	1,06
177	Baidu.com - ADR	32.226	0,72		Summe Indonesien	105.196	2,34
3.500	Hengan International Group Company Limited	29.016	0,65				
6.000	Minh Group Limited	21.080	0,47	MALAYSIA			
9.000	Shenzhou International Group Holdings Limited	62.662	1,39	7.800	IHH Healthcare Bhd	11.939	0,27
3.000	Sunny Optical Technology Group Company Limited	14.814	0,33		Summe Malaysia	11.939	0,27
7.600	Tencent Holdings Limited	208.717	4,64				
	Summe Kaimaninseln	482.981	10,75	MEXIKO			
CHINA				2.500	Alsea SAB de CV	8.497	0,19
4.000	Fuyao Glass Industry Group - H	10.934	0,24	2.411	Cemex SAB de CV - ADR	19.143	0,43
	Summe China	10.934	0,24	32.400	Cemex SAB de CV	25.714	0,57
KOLUMBIEN				1.922	Controladora Vuela Compania de Aviacion SAB de CV	33.424	0,74
518	Bancolombia SA - ADR	20.223	0,45	607	Fomento Economico Mexicano SA de CV - ADR	55.869	1,25
	Summe Kolumbien	20.223	0,45	5.100	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV	30.128	0,67
TSCHECHISCHE REPUBLIK				16.700	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	87.739	1,95
2.725	Komerční Banka AS	94.322	2,11	17.473	Nemak SAB de CV	19.339	0,43
	Summe Tschechische Republik	94.322	2,11	2.165	Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV	23.274	0,52
HONGKONG				13.000	TF Administradora Industrial S de RL de CV	21.562	0,48
12.000	China Mobile Limited	145.205	3,23	49.800	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	109.566	2,43
20.000	Cnooc Limited	24.807	0,55		Summe Mexiko	434.255	9,66
16.000	Techtronic Industries Company	62.507	1,39				
	Summe Hongkong	232.519	5,17				

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
PHILIPPINEN				TAIWAN (Fortsetzung)			
1.275	GT Capital Holdings Inc.	37.860	0,84	6.000	President Chain Store Corp.	47.663	1,06
205.700	Metro Pacific Investments Corp.	30.116	0,67	895	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	5.211	0,12
18.889	Metropolitan Bank & Trust	33.225	0,74	9.014	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited - ADR	275.738	6,13
	Summe Philippinen	101.201	2,25	9.000	Wistron NeWeb Corp.	28.397	0,63
POLEN					Summe Taiwan	420.823	9,36
2.869	Bank Pekao SA	92.726	2,06	THAILAND			
6.002	Eurocash SA	66.648	1,48	3.900	Airports of Thailand pcl	44.909	1,00
	Summe Polen	159.374	3,54	28.400	Central Pattana pcl	47.333	1,05
SÜDKOREA				180.900	Land & Houses pcl - NVDR	46.726	1,04
137	CJ O Shopping Company Limited	20.027	0,45	2.700	PTT pcl	26.415	0,59
782	Gs Retail Company Limited	34.934	0,78		Summe Thailand	165.383	3,68
909	Hyundai Development Company	42.341	0,94	Summe Aktien			
1.970	Korea Electric Power Corp. - ADR	48.029	1,06			3.875.453	86,24
107	Naver Corp.	85.787	1,91	Optionsscheine Aktien			
119	Samsung Electronics Company Limited	172.663	3,84	NIEDERLANDE			
478	Samsung Life Insurance	45.789	1,02	9.319	JPMorgan Structured Products BV - Dabur India Limited - Wts 20/05/2019	37.959	0,84
1.069	SK Telecom Company Limited - ADR	24.159	0,54	188	JPMorgan Structured Products BV - Eicher Goodearth Limited - Wts 08/08/2019	70.106	1,56
104	SK Telecom Company Limited	21.341	0,47		Summe Niederlande	108.065	2,40
	Summe Südkorea	495.070	11,01		Summe Optionsscheine Aktien	108.065	2,40
RUSSISCHE FÖDERATION				Strukturierte Schuldverschreibungen			
1.149	X5 Retail Group NV - GDR - Reg	33.287	0,74	INDIEN			
	Summe Russische Föderation	33.287	0,74	2.566	JPMorgan on Asian Paints Limited 0.00% 31/07/2018	44.734	1,00
SÜDAFRIKA				6.134	Zee Entertainment Enterprises Limited 0.00% 01/03/2017	50.371	1,12
441	Anglo Platinum Limited	12.393	0,28		Total India	95.105	2,12
1.328	Anglogold Ashanti Limited - ADR	21.142	0,47		Summe Strukturierte Schuldverschreibungen	95.105	2,12
1.546	Anglogold Ashanti Limited	24.929	0,55	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind			
3.230	Bid Corp. Limited	60.871	1,35			4.078.623	90,76
1.703	Bidvest Group Limited	20.011	0,45				
513	Naspers Limited	88.609	1,97				
3.569	Standard Bank Group Limited	36.510	0,81				
	Summe Südafrika	264.465	5,88				
TAIWAN							
49.875	E.Sun Financial Holding Company Limited	28.402	0,63				
15.000	Far Eastone Telecommunications Company Limited	35.412	0,79				

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
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt			
Aktien			
RUSSISCHE FÖDERATION			
19.000	Moscow Exchange MICEX-RTS	38.169	0,85
	Summe Russische Föderation	38.169	0,85
	Summe Aktien	38.169	0,85
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt		38.169	0,85
Wert der Anlagen insgesamt		4.116.792	91,61
(Gesamtkosten: USD 3.777.916)			

Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
AUSTRALIEN				ITALIEN			
7.884	Ansell Limited	123.370	1,39	1.279	Diasorin SpA	73.159	0,82
	Summe Australien	123.370	1,39	1.756	El Towers SpA	82.356	0,93
ÖSTERREICH				24.458	Finecobank Banca Fineco SpA	126.081	1,42
766	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	45.194	0,51	20.886	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	91.439	1,03
	Summe Österreich	45.194	0,51		Summe Italien	373.035	4,20
BERMUDAS				JAPAN			
2.257	Lazard Limited	73.024	0,82	1.700	Alps Electric Company Limited	35.852	0,40
	Summe Bermudas	73.024	0,82	6.100	Anicom Holdings Inc.	132.451	1,49
KANADA				11.200	Daifuku Company Limited	180.890	2,03
4.320	Davis + Henderson Corp.	82.951	0,93	1.900	Green Hospital Supply Inc.	51.590	0,58
3.667	Gildan Activewear Inc.	90.970	1,02	3.000	Nihon M&a Center Inc.	82.117	0,92
5.545	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	173.042	1,95	8.581	Osg Corp.	151.033	1,70
	Summe Kanada	346.963	3,90	5.900	Santen Pharmaceutical Company Limited	76.886	0,86
DÄNEMARK				4.806	Shimadzu Corp.	64.656	0,73
2.196	Simcorp A/S	113.542	1,28	1.300	Sho-Bond Holdings Company Limited	53.633	0,60
	Summe Dänemark	113.542	1,28	1.900	Sohgo Security Services Company Limited	90.157	1,01
FINNLAND				8.100	Yokogawa Electric Corp.	95.021	1,07
2.939	Basware OYJ	115.797	1,30		Summe Japan	1.014.286	11,39
	Summe Finnland	115.797	1,30	LUXEMBURG			
FRANKREICH				261	Eurofins Scientific	105.535	1,19
3.184	Criteo SA - ADR	99.475	1,12		Summe Luxemburg	105.535	1,19
3.345	Edenred	69.626	0,78	NIEDERLANDE			
6.744	Elis SA	99.103	1,12	394	Core Laboratories NV	39.382	0,44
2.491	Korian-Medica	71.380	0,80	3.075	Grandvision BV	76.106	0,85
	Summe Frankreich	339.584	3,82	2.965	IMCD Group NV	115.917	1,30
DEUTSCHLAND				2.745	Sensata Technologies Holding NV	94.724	1,06
2.994	CTS Eventim AG	94.880	1,07	2.628	Takeaway.com Holding BV	64.373	0,72
722	Grenkeleasing AG	123.643	1,39		Summe Niederlande	390.502	4,37
2.762	Norma Group	126.500	1,42	SPANIEN			
12.163	Tele Columbus AG	94.263	1,06	10.123	Applus Services SA	91.603	1,03
	Summe Deutschland	439.286	4,94	2.650	Cellnex Telecom SAU	42.665	0,48
IRLAND				7.753	Lar Espana Real Estate Socimi	49.619	0,56
13.497	Dalata Hotel Group Limited	55.338	0,62		Summe Spanien	183.887	2,07
	Summe Irland	55.338	0,62				

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
SCHWEDEN				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
2.596	Avanza AB	91.405	1,03	4.692	Servicemaster Global Holdings Inc.	140.618	1,59
12.408	Elektro AB - B	107.030	1,20	3.626	Spirit Airlines Inc.	137.225	1,54
6.629	Thule Group AB	100.867	1,13	2.255	SS&C Technologies Holdings Inc.	64.512	0,72
	Summe Schweden	299.302	3,36	802	Stericycle Inc.	57.192	0,64
SCHWEIZ				800	Svb Financial Group	78.690	0,88
31	Belimo Holding AG - Reg	91.030	1,02	3.470	Trex Company Inc.	181.311	2,04
23	Sika AG	99.735	1,12	2.157	Valvoline Inc.	45.086	0,51
	Summe Schweiz	190.765	2,14	645	Verisk Analytics Inc.	46.650	0,52
VEREINIGTES KÖNIGREICH				788	Watsco Inc.	98.798	1,11
15.845	Crest Nicholson Holdings plc	82.657	0,93	659	Wd-40 Company	65.929	0,74
4.280	Genus plc	96.372	1,08	1.973	Williams-Sonoma Inc.	89.679	1,01
16.904	Merlin Entertainments plc	85.895	0,96		Summe Vereinigte Staaten	3.900.001	43,81
3.280	Rathbone Brothers	69.382	0,78	Summe Aktien			
28.350	Tyman plc	91.592	1,03			8.621.926	96,86
4.779	Victrix plc	86.617	0,97	Optionsscheine Aktien			
	Summe Vereinigtes Königreich	512.515	5,75	LUXEMBURG			
VEREINIGTE STAATEN				7.039	Colgate-Palmolive India Limited - Wts 27/08/2019	91.315	1,02
1.321	Albemarle Corp.	100.491	1,13		Summe Luxemburg	91.315	1,02
2.150	Align Technology Inc.	179.359	2,02	NIEDERLANDE			
396	Alliance Data Systems Corp.	75.595	0,85	239	JPMorgan Structured Products BV - Eicher Goodearth Limited - Wts 08/08/2019	79.306	0,89
1.610	Ansys Inc.	132.677	1,49	2.941	JPMorgan Structured Products BV - Indusind Bank Limited - Wts 11/06/2019	47.008	0,53
1.845	Avis Budget Group Inc. P.P. 144A	56.164	0,63		Summe Niederlande	126.314	1,42
6.377	BankUnited Inc.	171.370	1,93	Summe Optionsscheine Aktien			
5.219	Blue Buffalo Pet Products	110.343	1,24			217.629	2,44
7.966	Catalent Inc.	183.165	2,06	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind			
5.339	Cinemark Holdings Inc.	181.862	2,04			8.839.555	99,30
5.264	CNO Financial Group Inc.	71.526	0,80	Wert der Anlagen insgesamt			
1.091	Cooper Companies Inc.	174.028	1,96			8.839.555	99,30
1.982	Cyrusone Inc.	83.897	0,94	(Gesamtkosten: EUR 8.430.106)			
4.537	Endologix Inc.	51.676	0,58				
1.408	FNF Group	46.244	0,52				
4.266	Gatx Corp.	169.114	1,90				
2.766	Graco Inc.	182.135	2,04				
893	Idexx Laboratories Inc.	89.578	1,01				
1.196	JB Hunt Transport Services Inc.	86.353	0,97				
2.822	Lkq Corp.	89.044	1,00				
2.309	Mednax Inc.	136.120	1,52				
301	Mettler-Toledo International Inc.	112.447	1,26				
3.410	Parametric Technology Corp.	134.451	1,51				
499	Pool Corp.	41.970	0,47				
4.048	Sabre Corp.	101.506	1,14				
5.640	Service Corp. International	133.196	1,50				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
KANADA				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
27.255	Magna International Inc.	1.170.602	0,62	30.523	Dr Pepper Snapple Group Inc.	2.787.055	1,47
	Summe Kanada	1.170.602	0,62	37.899	E*Trade Financial Corp.	1.103.619	0,58
IRLAND				32.882	Edison International	2.375.725	1,25
3.979	Allergan plc	916.403	0,48	37.971	Electronic Arts Inc.	3.242.723	1,71
28.535	Ingersoll-Rand plc	1.938.668	1,02	26.581	Eog Resources Inc.	2.570.649	1,36
45.722	Medtronic Inc.	3.950.381	2,09	40.152	Exxon Mobil Corp.	3.504.466	1,85
	Summe Irland	6.805.452	3,59	30.807	Facebook Inc. - A	3.951.614	2,09
SINGAPUR				15.821	General Dynamics Corp.	2.454.786	1,30
11.326	Broadcom Limited	1.953.962	1,03	12.252	Goldman Sachs Group Inc.	1.975.880	1,04
	Summe Singapur	1.953.962	1,03	21.017	Granite Construction Inc.	1.045.386	0,55
SCHWEIZ				71.068	Halliburton Company	3.189.532	1,68
23.590	Chubb Limited	2.964.084	1,56	30.645	Home Depot Inc.	3.943.400	2,08
	Summe Schweiz	2.964.084	1,56	99.151	Huntington Bancshares Inc.	977.629	0,52
VEREINIGTE STAATEN				83.635	Intel Corp.	3.157.221	1,67
23.826	AbbVie Inc.	1.502.706	0,79	39.908	Johnson & Johnson	4.714.332	2,50
11.318	Adobe Systems Inc.	1.228.456	0,65	82.436	JPMorgan Chase & Company	5.489.413	2,90
16.590	Albemarle Corp.	1.418.279	0,75	22.427	Lam Research Corp.	2.124.061	1,12
8.718	Alexandria Real Estate Equities Inc.	948.257	0,50	58.944	Leidos Holdings Inc.	2.551.096	1,35
12.204	Align Technology Inc.	1.144.125	0,60	15.774	Lockheed Martin Corp.	3.781.344	1,99
10.026	Alphabet Inc. - A	8.061.506	4,26	27.940	Masco Corp.	958.621	0,51
62.585	Altria Group Inc.	3.957.250	2,09	16.879	McDonald's Corp.	1.947.161	1,03
6.079	Amazon.com Inc.	5.090.007	2,68	127.865	Microsoft Corp.	7.365.023	3,89
15.138	Analog Devices Inc.	975.644	0,51	17.293	Nike Inc.	910.476	0,48
62.818	Apple Computer Company	7.101.575	3,75	22.238	Nucor Corp.	1.099.669	0,58
116.194	AT&T Inc.	4.718.638	2,49	28.675	Occidental Petroleum Corp.	2.090.981	1,10
25.635	Berkshire Hathaway Inc.	3.703.488	1,96	10.563	On Semiconductor Corp.	130.136	0,07
9.057	Biogen Idec Inc.	2.835.113	1,50	124.299	Pfizer Inc.	4.210.007	2,23
25.697	Bristol-Myers Squibb Company	1.385.582	0,73	57.294	Pg&e Corp.	3.504.673	1,85
21.085	Celgene Corp.	2.204.015	1,16	20.093	Ppg Industries Inc.	2.076.812	1,10
10.340	Cigna Corp.	1.347.509	0,71	5.699	Public Storage	1.271.675	0,67
153.119	Cisco Systems Inc.	4.856.935	2,56	9.804	Salesforce.com Inc.	699.319	0,37
70.386	Citigroup Inc.	3.324.331	1,75	31.083	Southwest Airlines Company	1.208.818	0,64
30.646	CME Group Inc.	3.203.120	1,69	43.152	Synchrony Financial	1.208.256	0,64
26.793	Coach Inc. P.P. 144A	979.552	0,52	46.601	Sysco Corp.	2.283.915	1,21
66.403	Comcast Corp.	4.405.175	2,32	23.209	Thermo Fisher Scientific Inc.	3.691.624	1,95
1	Cst Brands Inc.	48	0,00	21.814	Time Warner Inc.	1.736.613	0,92
30.313	CVS Health Corp.	2.697.554	1,42	21.365	Tyson Foods Inc. - A	1.595.325	0,84
55.716	Devon Energy Corp.	2.457.633	1,30	27.178	United Parcel Service Inc.	2.972.186	1,57
16.629	Digital Realty Trust Inc.	1.615.008	0,85	12.875	Vertex Pharmaceuticals Inc.	1.122.829	0,59
22.456	Dollar General Corp.	1.571.695	0,83	46.954	Visa Inc. - A	3.883.096	2,05
53.598	Dow Chemical Company	2.777.985	1,46		Summe Vereinigte Staaten	176.418.332	93,13
				Summe Aktien		189.312.432	99,93
				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind		189.312.432	99,93
				Wert der Anlagen insgesamt		189.312.432	99,93
				(Gesamtkosten: USD 173.454.434)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Select

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind			
Aktien			
KANADA			
1.363	Magna International Inc.	58.541	1,09
	Summe Kanada	58.541	1,09
IRLAND			
133	Allergan plc	30.631	0,57
1.667	Ingersoll-Rand plc	113.256	2,12
1.290	Medtronic Inc.	111.456	2,08
	Summe Irland	255.343	4,77
SINGAPUR			
784	Broadcom Limited	135.256	2,53
	Summe Singapur	135.256	2,53
SCHWEIZ			
997	Chubb Limited	125.273	2,34
	Summe Schweiz	125.273	2,34
VEREINIGTE STAATEN			
593	Adobe Systems Inc.	64.364	1,20
994	Albemarle Corp.	84.978	1,59
826	Align Technology Inc.	77.438	1,45
399	Alphabet Inc. - A	320.820	5,99
1.151	Altria Group Inc.	72.778	1,36
191	Amazon.com Inc.	159.926	2,99
1.160	Analog Devices Inc.	74.762	1,40
1.306	Apple Computer Company	147.643	2,76
7.876	Bank of America Corp.	123.259	2,30
859	BankUnited Inc.	25.942	0,48
3.382	BB&T Corp.	127.569	2,39
562	Berkshire Hathaway Inc.	81.192	1,52
341	Biogen Idec Inc.	106.743	2,00
546	Bristol-Myers Squibb Company	29.440	0,55
559	Celgene Corp.	58.432	1,09
423	Cigna Corp.	55.125	1,03
3.007	Cisco Systems Inc.	95.382	1,78
760	CME Group Inc.	79.435	1,48
2.185	Comcast Corp.	144.953	2,70
600	CVS Health Corp.	53.394	1,00
2.743	Devon Energy Corp.	120.994	2,26
855	Dollar General Corp.	59.841	1,12
1.621	Dow Chemical Company	84.016	1,57
757	Electronic Arts Inc.	64.648	1,21
697	Eog Resources Inc.	67.407	1,26
539	Facebook Inc. - A	69.138	1,29
711	General Dynamics Corp.	110.319	2,06
543	Goldman Sachs Group Inc.	87.570	1,64

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
2.988	Halliburton Company	134.101	2,50
642	Home Depot Inc.	82.613	1,54
1.009	Honeywell International Inc.	117.639	2,20
516	Lam Research Corp.	48.870	0,91
325	Leidos Holdings Inc.	14.066	0,26
456	Lockheed Martin Corp.	109.312	2,04
3.790	Microsoft Corp.	218.304	4,07
494	Nike Inc.	26.009	0,49
1.195	Occidental Petroleum Corp.	87.139	1,63
4.980	Pfizer Inc.	168.673	3,15
1.968	Pg&e Corp.	120.383	2,25
767	Ppg Industries Inc.	79.277	1,48
340	Salesforce.com Inc.	24.252	0,45
2.084	Southwest Airlines Company	81.047	1,51
3.360	Synchrony Financial	94.080	1,76
814	Sysco Corp.	39.894	0,75
966	Thermo Fisher Scientific Inc.	153.652	2,87
811	Time Warner Inc.	64.564	1,21
791	Tjx Companies Inc.	59.151	1,10
862	United Parcel Service Inc.	94.268	1,76
436	Vertex Pharmaceuticals Inc.	38.024	0,71
1.917	Visa Inc. - A	158.536	2,96
	Summe Vereinigte Staaten	4.661.362	87,07
	Summe Aktien	5.235.775	97,80
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	5.235.775	97,80
	Wert der Anlagen insgesamt	5.235.775	97,80

(Gesamtkosten: USD 4.538.547)

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

zum 30. September 2016

		% des				% des	
Anzahl	Anlage	Marktwert USD	Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
AUSTRALIEN				CHINA (Fortsetzung)			
67.892	Alumina Limited	75.853	1,03	51.000	Shanghai Fosun		
46.315	Asaleo Care Limited	56.354	0,77		Pharmaceutical Group		
14.564	Bellamy's Australia Limited	144.998	1,98		Company Limited - H	158.472	2,16
4.550	BHP Billiton Limited	77.925	1,06	560.000	Shanghai Jin Jiang		
16.957	Charter Hall Retail Reit	54.890	0,75		International	172.563	2,35
5.306	Commonwealth Bank of Australia	293.974	4,00		Summe China	1.408.358	19,19
37.991	Healthscope Limited	89.253	1,22				
2.317	Rio Tinto Limited	91.509	1,25	HONGKONG			
33.063	Santos Limited	91.338	1,24	42.600	Aia Group Limited	283.141	3,86
3.233	Sirtex Medical Limited	78.056	1,06	49.500	Boc Hong Kong Holdings Limited	167.213	2,27
183.415	Spotless Group Holdings Limited	150.183	2,05	370.000	China Jinmao Holdings Group		
21.313	Star Entertainment Grp Limited	98.185	1,34		Limited	114.016	1,56
33.274	Vicinity Centres	80.717	1,10	36.000	China Merchants Holdings		
26.524	Vocus Companycommunications Limited	126.453	1,72		International Company Limited	95.849	1,31
4.155	Westpac Banking Corp.	93.830	1,28	21.000	China Mobile Limited	254.108	3,47
	Summe Australien	1.603.518	21,85	25.000	Techtronic Industries Company	97.667	1,33
					Summe Hongkong	1.011.994	13,80
KAIMANINSELN				INDONESIEN			
2.781	Alibaba Group Holding	294.201	4,01	456.800	Lippo Cikarang Tbk PT	205.625	2,80
384	Netease.com - ADR	92.460	1,26		Summe Indonesien	205.625	2,80
129.000	Nexteer Automotive Group Limited	167.987	2,29	MALAYSIA			
82.000	Regina Miracle International Holdings Limited	112.069	1,53	200.300	7-Eleven Malaysia Holdings	87.182	1,19
6.100	Tencent Holdings Limited	167.523	2,28	67.200	Resorts World Bhd	73.936	1,01
12.065	Vipshop Holdings Limited	176.994	2,41		Summe Malaysia	161.118	2,20
106.000	Zhen Ding Technology Holding Limited	232.324	3,17	SÜDKOREA			
	Summe Kaimaninseln	1.243.558	16,95	1.486	Cuckoo Electronics Company Limited	192.269	2,62
CHINA				986	LG Chem Limited	147.272	2,01
346.000	Bank of China Limited - H	157.922	2,15	379	Ncsoft Corp.	101.689	1,39
235.000	Beijing Urban Construction Design & Development Group Company Limited	146.648	2,00	82	Samsung Electronics Company Limited	118.978	1,62
162.000	China Construction Bank Corp.	120.101	1,64	1.838	Shinhan Financial Group Company Limited	67.005	0,91
111.000	China Life Insurance Company Limited - H	286.230	3,89		Summe Südkorea	627.213	8,55
20.000	China Pacific Insurance Group Company Limited	73.879	1,01	SINGAPUR			
157.000	Industrial & Commercial Bank of China - H	98.176	1,34	70.200	Global Logistic Properties Limited	96.281	1,31
37.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	194.367	2,65	53.400	Wing Tai Holdings Limited	66.189	0,90
					Summe Singapur	162.470	2,21

103

Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
TAIWAN			
1.000	Largan Precision Company Limited	120.593	1,64
58.000	Pegatron Corp.	149.140	2,03
36.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	209.603	2,86
	Summe Taiwan	479.336	6,53
THAILAND			
24.700	Bangkok Bank plc - NVDR	115.837	1,58
7.000	Siam City Cement plc	59.798	0,81
	Summe Thailand	175.635	2,39
	Summe Aktien	7.078.825	96,47
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	7.078.825	96,47
	Wert der Anlagen insgesamt	7.078.825	96,47
(Gesamtkosten: USD 6.711.612)			

Threadneedle (Lux) - Asian Focus

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
KAIMANINSELN				SÜDKOREA			
3.000	Alibaba Group Holding	317.370	4,78	228	Amorepacific Corp.	80.531	1,21
138.000	Nexteer Automotive Group Limited	179.707	2,70	1.688	Cuckoo Electronics Company Limited	218.406	3,29
15.000	Tencent Holdings Limited	411.941	6,19	380	LG Chem Limited	56.758	0,85
10.000	Vipshop Holdings Limited	146.700	2,21	398	Ncsoft Corp.	106.787	1,61
35.000	Zhen Ding Technology Holding Limited	76.710	1,16	188	Samsung Electronics Company Limited	272.779	4,11
	Summe Kaimaninseln	1.132.428	17,04	650	Samsung Life Insurance	62.265	0,94
					Summe Südkorea	797.526	12,01
CHINA				SINGAPUR			
288.000	Bank of China Limited - H	131.450	1,98	138.000	Wing Tai Holdings Limited	171.051	2,57
238.000	Beijing Urban Construction Design & Development Group Company Limited	148.521	2,24		Summe Singapur	171.051	2,57
238.000	China Construction Bank Corp.	176.444	2,66	TAIWAN			
120.000	China Life Insurance Company Limited - H	309.439	4,66	100.000	Ctci Corp.	146.435	2,21
35.000	China Pacific Insurance Group Company Limited	129.288	1,95	18.000	Hota Industrial Manufacturing Company Limited	87.574	1,32
90.000	China Petroleum & Chemical Corp.	65.562	0,99	3.000	Largan Precision Company Limited	361.780	5,44
70.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	362.817	5,46	28.000	Pegatron Corp.	71.999	1,08
	Summe China	1.323.521	19,94	77.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	448.317	6,74
					Summe Taiwan	1.116.105	16,79
HONGKONG				THAILAND			
73.000	Aia Group Limited	485.194	7,30	37.000	Bangkok Bank plc - NVDR	173.521	2,61
38.000	Boc Hong Kong Holdings Limited	128.366	1,93	130.000	Sino-Thai Engineering & Construction Public	88.542	1,33
50.000	China Merchants Holdings International Company Limited	133.123	2,00		Summe Thailand	262.063	3,94
22.000	China Mobile Limited	266.208	4,01		Summe Aktien	6.293.763	94,72
20.000	Techtronic Industries Company	78.133	1,18		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	6.293.763	94,72
	Summe Hongkong	1.091.024	16,42		Wert der Anlagen insgesamt	6.293.763	94,72
					(Gesamtkosten: USD 5.810.107)		
INDIEN							
3.800	Larsen & Toubro Limited - GDR	81.320	1,22				
	Summe Indien	81.320	1,22				
INDONESIEN							
310.000	Lippo Cikarang Tbk PT	139.544	2,10				
	Summe Indonesien	139.544	2,10				
MALAYSIA							
260.000	7-Eleven Malaysia Holdings	113.167	1,70				
60.000	Resorts World Bhd	66.014	0,99				
	Summe Malaysia	179.181	2,69				

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
THAILAND			
75.000	Bangkok Bank plc - NVDR	351.731	1,08
	Summe Thailand	351.731	1,08
	Summe Aktien	31.212.192	96,18
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	31.212.192	96,18
	Wert der Anlagen insgesamt	31.212.192	96,18
(Gesamtkosten: USD 30.084.046)			

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind			
Aktien			
BERMUDAS			
57.490	Invesco Limited	1.797.712	0,23
	Summe Bermudas	1.797.712	0,23
KANADA			
321.405	Canadian Natural Resources Limited	10.297.816	1,34
	Summe Kanada	10.297.816	1,34
CURACAO			
94.980	Schlumberger Limited	7.469.227	0,97
	Summe Curacao	7.469.227	0,97
IRLAND			
8.254	Allergan plc	1.900.979	0,25
80.987	Eaton Corp.	5.321.656	0,69
187.929	Medtronic Inc.	16.237.066	2,10
	Summe Irland	23.459.701	3,04
JERSEY - KANALINSELN			
128.419	Delphi Automotive plc	9.158.843	1,19
	Summe Jersey - Kanalinseln	9.158.843	1,19
LIBERIA			
21.955	Royal Caribbean Cruises Limited	1.645.527	0,21
	Summe Liberia	1.645.527	0,21
SINGAPUR			
55.200	Broadcom Limited	9.523.104	1,24
	Summe Singapur	9.523.104	1,24
VEREINIGTES KÖNIGREICH			
57.592	Aon Corp.	6.478.524	0,84
40.374	Diageo plc - ADR	4.684.999	0,61
263.640	Nielsen Holdings plc	14.123.195	1,83
	Summe Vereinigtes Königreich	25.286.718	3,28
VEREINIGTE STAATEN			
194.905	Abbott Laboratories	8.242.532	1,07
268.875	Activision Blizzard Inc.	11.911.163	1,54
19.695	Advance Auto Parts Inc.	2.936.918	0,38
57.200	Akamai Technologies Inc.	3.031.028	0,39
12.685	Alphabet Inc. - A	10.199.501	1,32

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
29.441	Alphabet Inc. - C	22.884.195	2,97
92.140	American Tower Corp.	10.442.226	1,35
79.520	Anthem Inc.	9.964.651	1,29
251.845	Apple Computer Company	28.471.077	3,69
116.883	Aramark Holdings Corp.	4.445.060	0,58
277.055	Bank of New York Mellon Corp.	11.048.953	1,43
163.382	Berkshire Hathaway Inc.	23.603.798	3,06
29.745	Biogen Idec Inc.	9.311.077	1,20
15.873	Blackrock Inc.	5.753.328	0,75
86.827	Cardinal Health Inc.	6.746.458	0,88
106.704	CB Richard Ellis Group Inc.	2.985.578	0,39
65.415	Celgene Corp.	6.837.830	0,89
106.376	Chevron Corp.	10.948.218	1,42
34.069	Cigna Corp.	4.439.872	0,58
458.692	Citigroup Inc.	21.664.023	2,82
203.510	Coach Inc. P.P. 144A	7.440.326	0,97
307.846	Comcast Corp.	20.422.504	2,65
183.880	Conocophillips	7.993.264	1,04
46.859	Cooper Companies Inc.	8.399.944	1,09
126.959	CVS Health Corp.	11.298.081	1,47
58.001	DTE Energy Company	5.432.954	0,70
28.192	Dun & Bradstreet Corp.	3.851.591	0,50
86.864	Edison International	6.275.924	0,82
93.798	Electronic Arts Inc.	8.010.349	1,04
49.690	EQT Corp.	3.608.488	0,47
57.960	Expedia Inc.	6.765.091	0,88
158.290	Exxon Mobil Corp.	13.815.551	1,78
158.300	Facebook Inc. - A	20.305.141	2,63
95.949	Fedex Corp.	16.760.371	2,17
77.425	Fidelity National Information Services Inc.	5.964.048	0,77
200.424	General Electric Company	5.936.559	0,77
125.319	Honeywell International Inc.	14.610.942	1,90
17.797	Intuit Inc.	1.957.848	0,25
157.190	Johnson & Johnson	18.568.855	2,41
299.802	JPMorgan Chase & Company	19.963.815	2,59
188.450	Kroger Company	5.593.196	0,73
196.238	Lowe's Companies Inc.	14.170.346	1,84
28.187	Marriott International Inc.	1.897.831	0,25
104.193	Mastercard Inc. - A	10.603.722	1,37
95.695	McDonald's Corp.	11.039.375	1,43
154.975	Michaels Companies Inc.	3.745.746	0,49
364.828	Microsoft Corp.	21.014.092	2,74
43.610	Monsanto Company	4.456.942	0,58
520.975	Morgan Stanley	16.702.459	2,17
110.395	Newell Rubbermaid Inc.	5.813.401	0,75
153.447	Noble Energy Inc.	5.484.196	0,71
27.335	Palo Alto Networks Inc.	4.355.286	0,56
147.155	PepsiCo Inc.	16.006.049	2,07

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
570.125	Pfizer Inc.	19.310.134	2,49
97.210	Philip Morris International Inc.	9.450.756	1,23
69.241	Pvh Corp.	7.651.131	0,99
88.720	Qualcomm Inc.	6.077.320	0,79
68.615	S&P Global Inc.	8.683.914	1,13
5.273	Skyworks Solutions Inc.	401.486	0,05
450.944	Verizon Communications Inc.	23.440.069	3,04
30.096	Vertex Pharmaceuticals Inc.	2.624.672	0,34
114.177	Walgreens Boots Alliance Inc.	9.204.950	1,19
33.620	Walt Disney Company	3.121.953	0,40
292.581	Wells Fargo & Company	12.955.487	1,68
82.165	Zimmer Holdings Inc.	10.683.093	1,39
	Summe Vereinigte Staaten	657.736.738	85,31
Summe Aktien		746.375.386	96,81
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind		746.375.386	96,81
Wert der Anlagen insgesamt		746.375.386	96,81
(Gesamtkosten: USD 685.386.415)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BELGIEN				ITALIEN			
14.845	Anheuser-Busch InBev NV	1.730.927	1,71	151.413	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	662.886	0,65
20.724	KBC Bank	1.073.918	1,06				
	Summe Belgien	2.804.845	2,77		Summe Italien	662.886	0,65
DÄNEMARK				NIEDERLANDE			
56.731	Novo Nordisk A/S	2.098.205	2,07	31.911	Akzo Nobel NV	1.923.914	1,90
14.780	Pandora A/S	1.589.902	1,57	27.087	ASML Holding NV	2.646.129	2,61
	Summe Dänemark	3.688.107	3,64	95.457	ING Groep NV	1.049.072	1,04
FINNLAND				140.976	Reed Elsevier NV	2.254.911	2,23
23.196	Kone Oyj	1.047.763	1,03		Summe Niederlande	7.874.026	7,78
26.417	Sampo OYJ - A	1.046.113	1,03	SPANIEN			
	Summe Finnland	2.093.876	2,06	50.601	Amadeus IT Holding SA - A	2.250.227	2,22
FRANKREICH				73.275	Cellnex Telecom SAU	1.179.728	1,16
25.548	Amundi SA	1.187.982	1,17	107.800	Ferrovial SA	2.042.810	2,02
55.506	AXA SA	1.051.284	1,04	46.594	Inditex SA	1.537.602	1,52
10.198	Compagnie Generale d'Optique Essilor International	1.170.731	1,16		Summe Spanien	7.010.367	6,92
11.609	Dassault Systemes SA	896.563	0,89	SCHWEDEN			
22.077	Legrand SA	1.158.601	1,14	84.625	Atlas Company AB - B	2.270.319	2,25
6.950	L'Oreal SA	1.168.295	1,15	135.543	Svenska Handelsbanken AB	1.659.796	1,63
10.804	Pernod-Ricard SA	1.138.201	1,12		Summe Schweden	3.930.115	3,88
31.691	Schneider Electric SA	1.966.743	1,95	SCHWEIZ			
	Summe Frankreich	9.738.400	9,62	17.716	Compagnie Financiere Richemont SA - Reg	962.710	0,95
DEUTSCHLAND				52.468	Nestle SA - Reg	3.686.784	3,64
7.954	Allianz SE - Reg	1.050.723	1,04	40.906	Novartis AG - Reg	2.868.721	2,83
9.439	Bayer AG	844.130	0,83	22.815	Roche Holding AG	5.047.143	4,99
19.129	Brenntag AG	929.765	0,92	706	Sika AG	3.061.417	3,02
10.809	Continental AG	2.022.904	2,00		Summe Schweiz	15.626.775	15,43
168.320	Deutsche Telekom AG - Reg	2.511.335	2,48	VEREINIGTES KÖNIGREICH			
24.540	Fresenius Medical Care AG & Company KGaA	1.908.230	1,88	217.821	3i Group plc	1.637.824	1,62
	Summe Deutschland	9.267.087	9,15	36.577	British American Tobacco plc	2.084.372	2,06
IRLAND				425.278	BT Group plc	1.912.487	1,89
86.756	CRH plc	2.569.206	2,54	68.187	Burberry Group plc	1.086.891	1,07
65.857	Kingspan Group plc	1.579.251	1,56	64.301	Compass Group plc	1.111.167	1,10
9.279	Paddy Power plc	934.395	0,92	43.930	Imperial Tobacco Group plc	2.017.691	1,99
178.409	Ryanair Holdings plc	2.173.022	2,15	478.461	Itv plc	1.035.315	1,02
	Summe Irland	7.255.874	7,17	247.531	John Wood Group plc	2.173.090	2,15
				34.962	Johnson Matthey plc	1.331.190	1,31
				340.558	Legal & General Group plc	860.915	0,85
				79.740	Persimmon plc	1.672.912	1,65

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)			
85.232	Prudential plc	1.346.271	1,33
15.756	Reckitt Benckiser Group plc	1.323.128	1,31
176.749	Royal Dutch Shell plc - B	4.079.954	4,03
79.242	Smith & Nephew plc	1.139.452	1,12
155.891	St James's Place plc	1.708.243	1,68
109.697	Unilever plc	4.633.861	4,57
	Summe Vereinigtes Königreich	31.154.763	30,75
Summe Aktien		101.107.121	99,82
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind		101.107.121	99,82
Wert der Anlagen insgesamt		101.107.121	99,82
(Gesamtkosten: EUR 97.171.599)			

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
ÖSTERREICH				DEUTSCHLAND			
50.338	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	2.969.942	0,98	58.904	Brenntag AG	2.863.029	0,94
	Summe Österreich	2.969.942	0,98	37.332	Compugroup Holding AG	1.531.919	0,50
BELGIEN				186.266	CTS Eventim AG	5.902.770	1,94
72.003	Kinopolis Group NV	2.980.923	0,98	22.903	Grenkeleasing AG	3.922.139	1,29
49.525	Melexis	3.164.152	1,04	87.649	Hella KGaA Hueck & Company	3.090.504	1,02
153.410	Ontex Group NV	4.332.298	1,42	122.631	Norma Group	5.616.500	1,84
27.060	Telenet Group Holding NV	1.256.396	0,41	54.296	Sartorius AG	4.022.247	1,32
51.285	Umicore	2.863.242	0,94	79.282	Stabilus GmbH	3.972.028	1,31
	Summe Belgien	14.597.011	4,79	40.304	Stratec Biomedical AG	2.067.595	0,68
DÄNEMARK				748.906	Tele Columbus AG	5.804.022	1,91
80.061	Ambu A/S	3.827.670	1,26	17.481	Zooplus AG	2.255.049	0,74
26.450	Christian Hansen Holding A/S	1.399.540	0,46		Summe Deutschland	41.047.802	13,49
23.558	Pandora A/S	2.534.162	0,83	GRIECHENLAND			
64.511	Simcorp A/S	3.335.478	1,10	192.860	RIB Software AG	2.113.746	0,69
168.161	Tryg A/S	3.003.589	0,99		Summe Griechenland	2.113.746	0,69
	Summe Dänemark	14.100.439	4,64	IRLAND			
FINNLAND				753.802	Dalata Hotel Group Limited	3.090.588	1,02
95.149	Basware OYJ	3.748.871	1,23	1.147.795	Irish Continental Group plc	5.015.864	1,65
71.851	Cargotec Corp.	2.935.113	0,96	212.667	Kingspan Group plc	5.133.781	1,69
51.472	Konecranes Oyj	1.623.427	0,53	11.798	Paddy Power plc	1.188.059	0,39
214.473	Tikkurila Oyj	4.107.158	1,35		Summe Irland	14.428.292	4,75
86.185	Vaisala Oyj	2.714.828	0,89	ISLE OF MAN			
	Summe Finnland	15.129.397	4,96	609.181	Paysafe Group plc	3.141.223	1,03
FRANKREICH					Summe Isle of Man	3.141.223	1,03
146.676	Bureau Veritas SA	2.800.778	0,92	ITALIEN			
122.506	Criteo SA - ADR	3.827.358	1,26	86.881	Banca Generali SpA	1.483.927	0,49
189.176	Edenred	3.937.698	1,29	607.874	Davide Campari-Milano SpA	6.096.976	2,00
380.977	Elis SA	5.598.458	1,84	103.149	Diasorin SpA	5.900.122	1,94
271.798	Groupe Eurotunnel SA	2.619.046	0,86	111.532	El Towers SpA	5.230.851	1,72
43.043	Ingenico	3.347.454	1,10	947.280	Fincobank Banca Fineco SpA	4.883.229	1,60
187.777	Korian-Medica	5.380.750	1,77	966.593	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	4.231.744	1,39
97.803	Lisi SA	2.408.888	0,79	260.691	Marr SpA	4.650.727	1,53
31.150	Nexity	1.463.739	0,48		Summe Italien	32.477.576	10,67
58.190	Orpea	4.590.027	1,51	LUXEMBURG			
31.665	Teleperformance	3.005.958	0,99	68.175	Braas Monier Building Group SA	1.773.914	0,58
	Summe Frankreich	38.980.154	12,81	16.597	Eurofins Scientific	6.710.997	2,20
					Summe Luxemburg	8.484.911	2,78

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
NIEDERLANDE				VEREINIGTE STAATEN			
221.750	Grandvision BV	5.488.313	1,80	27.259	Autoliv Inc.	2.576.410	0,85
144.633	IMCD Group NV	5.654.426	1,86		Summe Vereinigte Staaten	2.576.410	0,85
64.777	Sligro Food Group NV	2.139.584	0,70		Summe Aktien	303.148.893	99,61
133.997	Takeaway.com Holding BV	3.282.257	1,08		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	303.148.893	99,61
	Summe Niederlande	16.564.580	5,44		Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		
SPANIEN				Aktien			
583.697	Applus Services SA	5.281.875	1,74	DÄNEMARK			
333.951	Lar Espana Real Estate Socimi	2.137.286	0,70	49.761	Ow Bunker A/S*	0	0,00
397.583	Telepizza Group SA	1.606.235	0,53		Summe Dänemark	0	0,00
	Summe Spanien	9.025.396	2,97		Summe Aktien	0	0,00
SCHWEDEN					Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	0	0,00
166.648	Avanza AB	5.867.641	1,93	Wert der Anlagen insgesamt			
1.006.426	Cloetta AB	3.250.918	1,07		303.148.893	99,61	
377.867	Dometic Group AB	2.702.132	0,89		(Gesamtkosten: EUR 272.698.333)		
380.679	Elektro AB - B	3.283.691	1,08		<i>* Illiquides Wertpapier.</i>		
371.068	Hexpol AB	2.963.763	0,97				
227.997	Thule Group AB	3.469.209	1,14				
	Summe Schweden	21.537.354	7,08				
SCHWEIZ							
1.716	Belimo Holding AG - Reg	5.038.944	1,66				
10.594	Burckhardt Compression Holding AG	2.676.673	0,88				
1.648	Sika AG	7.146.200	2,34				
	Summe Schweiz	14.861.817	4,88				
VEREINIGTES KÖNIGREICH							
900.081	Ascential plc	2.923.534	0,96				
146.235	Aveva Group plc	3.373.898	1,11				
974.909	Booker Group plc	2.005.877	0,66				
628.909	Crest Nicholson Holdings plc	3.280.752	1,08				
90.247	Dialog Semiconductor plc	3.096.826	1,02				
235.636	Genus plc	5.305.800	1,74				
648.781	Howden Joinery Group plc	3.241.930	1,07				
587.898	Ibstock plc	1.097.475	0,36				
595.528	Just Eat plc	3.689.668	1,21				
52.918	Livanova plc	2.806.236	0,92				
584.349	Merlin Entertainments plc	2.969.274	0,98				
51.501	Rightmove plc	2.513.357	0,83				
366.842	St James's Place plc	4.019.829	1,32				
1.682.912	Tyman plc	5.437.052	1,78				
295.254	Victrex plc	5.351.335	1,76				
	Summe Vereinigtes Königreich	51.112.843	16,80				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - European Select

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BELGIEN				NIEDERLANDE			
3.654	Anheuser-Busch InBev NV	426.057	4,02	4.078	Akzo Nobel NV	245.863	2,32
	Summe Belgien	426.057	4,02	1.175	ASML Holding NV	114.786	1,08
DÄNEMARK				3.446	Heineken Holding NV	245.975	2,32
8.237	Novo Nordisk A/S	304.647	2,88	6.123	IMCD Group NV	239.379	2,26
	Summe Dänemark	304.647	2,88	34.878	Reed Elsevier NV	557.874	5,27
FINNLAND				16.049	Unilever NV	659.213	6,23
2.341	Kone Oyj	105.743	1,00		Summe Niederlande	2.063.090	19,48
9.904	Sampo OYJ - A	392.198	3,71	SPANIEN			
	Summe Finnland	497.941	4,71	5.509	Amadeus IT Holding SA - A	244.985	2,32
FRANKREICH				8.684	Cellnex Telecom SAU	139.812	1,32
1.096	Compagnie Generale d'Optique	125.821	1,19	5.005	Inditex SA	165.165	1,56
	Essilor International	110.053	1,04		Summe Spanien	549.962	5,20
1.425	Dassault Systemes SA	125.407	1,19	SCHWEDEN			
8.534	Elis SA	230.072	2,17	20.868	Assa Abloy AB	377.783	3,57
4.384	Legrand SA	428.487	4,05	11.719	Atlas Companynco AB - B	314.397	2,97
2.549	L'Oreal SA	423.191	4,00	31.383	Svenska Handelsbanken AB	384.301	3,63
4.017	Pernod-Ricard SA	116.598	1,10		Summe Schweden	1.076.481	10,17
1.732	Publicis Groupe			SCHWEIZ			
	Summe Frankreich	1.559.629	14,74	4.114	Compagnie Financiere		
DEUTSCHLAND					Richemont SA - Reg	223.560	2,12
5.663	Brenntag AG	275.250	2,61	115	Givaudan - Reg	208.695	1,97
1.750	Continental AG	327.512	3,10	3.490	Nestle SA - Reg	245.233	2,32
5.331	Fresenius Medical Care AG & Company KGaA	414.539	3,92	8.206	Novartis AG - Reg	575.484	5,44
10.851	Tele Columbus AG	84.095	0,79	1.627	Roche Holding AG	359.925	3,40
	Summe Deutschland	1.101.396	10,42	25	Sika AG	108.407	1,02
IRLAND					Summe Schweiz	1.721.304	16,27
6.400	Kingspan Group plc	153.472	1,46	VEREINIGTE STAATEN			
21.607	Ryanair Holdings plc	263.173	2,49	2.531	Autoliv Inc.	240.533	2,27
	Summe Irland	416.645	3,95		Summe Vereinigte Staaten	240.533	2,27
ITALIEN				Summe Aktien			
26.669	Davide Campari-Milano SpA	267.490	2,53		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	10.440.174	98,67
887	El Towers SpA	41.600	0,39		Wert der Anlagen insgesamt	10.440.174	98,67
15.880	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	69.523	0,66		(Gesamtkosten: EUR 10.417.923)		
2.443	Luxottica Group SpA	103.876	0,98				
	Summe Italien	482.489	4,56				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
AUSTRALIEN				MALAYSIA			
62.558	BHP Billiton Limited	1.071.387	2,81	1.217.600	Unisem (M) Bhd	741.955	1,95
14.606	Commonwealth Bank of Australia	809.232	2,12		Summe Malaysia	741.955	1,95
11.997	Macquarie Group Limited	752.267	1,97				
373.369	Mirvac Group	640.014	1,68	PAKISTAN			
23.147	Rio Tinto Limited	914.180	2,40	305.600	Habib Bank Limited	646.049	1,69
141.454	Sydney Airport	754.486	1,98		Summe Pakistan	646.049	1,69
112.624	Transurban Group	979.929	2,57				
320.992	Vicinity Centres	778.676	2,04	PHILIPPINEN			
28.578	Westpac Banking Corp.	645.363	1,69	10.350	Globe Telecom Inc.	435.392	1,14
	Summe Australien	7.345.534	19,26		Summe Philippinen	435.392	1,14
KAIMANINSELN				SÜDKOREA			
103.000	Cheung Kong Property Holding	751.654	1,97	10.515	Korea Electric Power Corp.	515.560	1,35
385.000	HKT Trust and Hkt Limited	542.060	1,42	3.357	LG Chem Limited	501.411	1,32
182.000	Sands China Limited	789.624	2,07	77.335	Macquarie Korea Infrastructure Fund	618.626	1,62
	Summe Kaimaninseln	2.083.338	5,46	2.413	Ncsoft Corp.	647.427	1,70
CHINA				1.155	Samsung Electronics Company Limited Pfd	1.352.846	3,55
279.500	Anhui Conch Cement Company Limited	765.781	2,01		Summe Südkorea	3.635.870	9,54
1.911.000	Bank of China Limited - H	872.224	2,29	SINGAPUR			
1.724.000	China Construction Bank Corp.	1.278.114	3,36	889.700	Frasers Logistics & Industrial Trust	649.274	1,70
1.030.000	China Petroleum & Chemical Corp.	750.326	1,97	496.599	Mapletree Commercial Trust	582.756	1,53
1.098.000	Sinopec Shanghai Petrochemical Company Limited	553.532	1,45		Summe Singapur	1.232.030	3,23
	Summe China	4.219.977	11,08	TAIWAN			
HONGKONG				782.000	Advanced Semiconductor Engineering Inc.	938.050	2,46
319.500	Boc Hong Kong Holdings Limited	1.079.285	2,84	65.000	Catcher Technology Company Limited	527.755	1,38
1.236.000	Champion Reit	748.998	1,96	213.000	Chroma ATE Inc.	572.847	1,50
82.500	China Mobile Limited	998.280	2,62	852.000	King Yuan Electronics Company Limited	757.001	1,99
68.500	Power Assets Holdings Limited	667.693	1,75	166.000	Realtek Semiconductor Corp.	545.477	1,43
580.000	Xinyi Glass Holdings Limited	524.216	1,37	176.000	Sitronix Technology Corp.	581.145	1,53
	Summe Hongkong	4.018.472	10,54	380.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	2.212.474	5,80
INDONESIEN				276.170	Wistron NeWeb Corp.	871.373	2,29
2.993.000	Telekomunikasi Indonesia Tbk Pt	988.385	2,59		Summe Taiwan	7.006.122	18,38
	Summe Indonesien	988.385	2,59				

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
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
THAILAND			
219.800	KCE Electronics - NVDR	672.403	1,77
1.842.700	Land & Houses pcl - NVDR	475.964	1,25
1.146.900	Samui Airport Property Fund	910.237	2,39
145.300	Thai Oil pcl - NVDR	287.245	0,75
3.114.700	Thai Wah pcl-Nvdr Twpc-R Tb	705.638	1,85
1.482.700	True Telecommunication Growth Infrastructure Fund	633.303	1,66
	Summe Thailand	3.684.790	9,67
Summe Aktien		36.037.914	94,53
Fonds			
THAILAND			
2.390.600	BTS Rail Mass Transit Growth Infrastructure Fund	862.409	2,26
	Summe Thailand	862.409	2,26
Summe Fonds		862.409	2,26
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind		36.900.323	96,79
Wert der Anlagen insgesamt		36.900.323	96,79
(Gesamtkosten: USD 34.290.085)			

Threadneedle (Lux) - Greater China Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
TAIWAN (Fortsetzung)			
16.490	Hon Hai Precision Industry Company Limited	41.560	0,95
25.000	King Yuan Electronics Company Limited	22.212	0,51
1.303	Largan Precision Company Limited	157.133	3,58
6.000	Sitronix Technology Corp.	19.812	0,45
8.000	Taiwan Mobile Company Limited	28.713	0,65
67.473	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	392.848	8,95
11.330	Wistron NeWeb Corp.	35.748	0,81
	Summe Taiwan	899.474	20,47
VEREINIGTE STAATEN			
223	China Biologic Products Inc.	27.759	0,63
	Summe Vereinigte Staaten	27.759	0,63
	Summe Aktien	4.231.216	96,35
Optionsscheine Aktien			
LUXEMBURG			
9.398	JP Morgan Hangzhou Hikvision Warrant - Wts	34.478	0,79
	Summe Luxemburg	34.478	0,79
	Summe Optionsscheine Aktien	34.478	0,79
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	4.265.694	97,14
	Wert der Anlagen insgesamt	4.265.694	97,14
(Gesamtkosten: USD 3.523.759)			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Energy Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
KANADA				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
29.533	Canadian Natural Resources Limited	942.449	3,41	17.861	Chevron Corp.	1.838.254	6,63
9.806	Enbridge Inc.	430.218	1,56	2.324	Cimarex Energy Company	312.276	1,13
10.660	Encana Corp.	111.203	0,40	15.431	Cobalt International Energy	19.134	0,07
8.575	Imperial Oil Limited	267.771	0,97	8.810	Conocophillips	382.971	1,38
4.158	Methanex Corp.	148.357	0,54	1.420	Continental Resources Inc.	73.783	0,27
36.473	Suncor Energy Inc.	1.010.726	3,65	2.676	Delek US Holdings Inc.	46.268	0,17
4.673	Suncor Energy Inc.	129.816	0,47	20.591	Devon Energy Corp.	908.269	3,28
6.528	Tourmaline Oil Corp.	176.530	0,64	12.454	Enterprise Products Partners LP	344.104	1,24
7.307	Transcanada Corp.	346.433	1,25	7.301	Eog Resources Inc.	706.080	2,55
	Summe Kanada	3.563.503	12,89	4.591	EQT Corp.	333.398	1,20
CURACAO				26.833	Exxon Mobil Corp.	2.341.983	8,45
19.157	Schlumberger Limited	1.506.507	5,44	7.099	FMC Technologies Inc.	210.627	0,76
	Summe Curacao	1.506.507	5,44	15.759	Halliburton Company	707.264	2,56
FRANKREICH				33.515	Kinder Morgan Inc.	775.202	2,80
2.631	Total SA - ADR	125.499	0,45	9.252	Marathon Petroleum Corp.	375.539	1,36
21.373	Total SA	1.012.880	3,66	2.490	Newfield Exploration Company	108.215	0,39
	Summe Frankreich	1.138.379	4,11	7.862	Noble Energy Inc.	280.988	1,02
ITALIEN				14.103	Occidental Petroleum Corp.	1.028.391	3,72
17.457	ENI SpA	251.505	0,91	3.138	Pbf Energy Inc.	71.044	0,26
	Summe Italien	251.505	0,91	6.531	PBF Logistics LP	129.444	0,47
SCHWEIZ				6.136	Phillips 66	494.255	1,79
17.253	Weatherford International Limited	96.962	0,35	13.632	Plains Gp Holdings LP	176.398	0,64
	Summe Schweiz	96.962	0,35	2.800	Rsp Permian Inc.	108.584	0,39
VEREINIGTES KÖNIGREICH				4.064	Spectra Energy Corp.	173.736	0,63
25.322	BP plc - ADR	890.322	3,22	1.108	Tesoro Corp.	88.152	0,32
222.091	BP plc	1.298.233	4,68	7.517	Valero Energy Corp.	398.401	1,44
132.324	Cairn Energy plc	323.151	1,17	4.906	Williams Companies Inc.	150.761	0,54
52.140	Ophir Energy plc	52.321	0,19		Summe Vereinigte Staaten	14.885.744	53,78
90.593	Royal Dutch Shell plc - A	2.252.401	8,13		Summe Aktien	26.259.028	94,87
	Summe Vereinigtes Königreich	4.816.428	17,39		Optionsscheine Aktien		
VEREINIGTE STAATEN					VEREINIGTE STAATEN		
9.901	Amerada Hess Corp.	530.892	1,92	56.938	Kinder Morgan Inc. - Wts 25/05/2017	883	0,00
15.776	Anadarko Petroleum Corp.	999.567	3,61		Summe Vereinigte Staaten	883	0,00
4.470	Antero Resources Corp.	120.467	0,44		Summe Optionsscheine Aktien	883	0,00
4.795	Baker Hughes Inc.	242.004	0,87		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	26.259.911	94,87
11.477	Cabot Oil & Gas Corp.	296.107	1,07				
2.596	Cheniere Energy Inc.	113.186	0,41				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Energy Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Sonstige Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren			
Fonds			
VEREINIGTE STAATEN			
11.757	Energy Select Sector SPDR Fund	830.161	3,00
11.925	SPDR S&P Oil & Gas Exploration	458.636	1,66
	Summe Vereinigte Staaten	1.288.797	4,66
	Summe Fonds	1.288.797	4,66
	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren	1.288.797	4,66
	Wert der Anlagen insgesamt	27.548.708	99,53
(Gesamtkosten: USD 29.376.112)			

Threadneedle (Lux) - Global Technology

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind			
Aktien			
BERMUDAS			
52.335	Travelport Worldwide Limited	786.595	1,40
	Summe Bermudas	786.595	1,40
CHINA			
4.600	Ctrip.com International Limited - ADR	214.222	0,38
	Summe China	214.222	0,38
FRANKREICH			
2.900	Publicis Groupe	219.397	0,39
	Summe Frankreich	219.397	0,39
ISRAEL			
7.412	Check Point Software Technologies	575.245	1,03
8.439	Cyberark Software Limited	418.321	0,75
5.550	Kornit Digital Limited	52.059	0,09
17.900	Mellanox Technologies Limited	774.175	1,38
11.400	Orbotech Limited	337.554	0,61
36.514	Tower Semiconductor Limited	554.283	0,99
	Summe Israel	2.711.637	4,85
JAPAN			
5.000	Mabuchi Motor Company Limited	273.540	0,49
	Summe Japan	273.540	0,49
NIEDERLANDE			
8.327	NXP Semiconductor NV	849.437	1,51
	Summe Niederlande	849.437	1,51
SINGAPUR			
22.680	Broadcom Limited	3.912.754	6,98
	Summe Singapur	3.912.754	6,98
VEREINIGTES KÖNIGREICH			
16.900	Arris International plc	478.777	0,85
	Summe Vereinigtes Königreich	478.777	0,85

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN			
1.973	Activision Blizzard Inc.	87.404	0,16
7.115	Advanced Energy Industries Inc.	336.682	0,60
1.700	Alphabet Inc. - A	1.366.902	2,44
2.002	Alphabet Inc. - C	1.556.135	2,77
25.504	Apple Computer Company	2.883.227	5,13
9.900	Applied Materials Inc.	298.485	0,53
12.698	Arista Networks Inc.	1.080.345	1,93
6.100	Brocade Communications Systems Inc.	56.303	0,10
22.906	Cavium Inc.	1.333.129	2,38
31.000	Cisco Systems Inc.	983.320	1,75
3.000	Cognizant Technology Solutions Corp. - A	143.130	0,26
6.723	Commscope Holding Company Inc.	202.430	0,36
38.500	CPI Card Group Inc.	232.540	0,41
23.142	Cypress Semiconductor Corp.	281.407	0,50
14.200	Ebay Inc.	467.180	0,83
19.326	Electronics for Imaging Inc.	945.428	1,69
3.395	Euronet Worldwide Inc.	277.813	0,50
4.846	F5 Networks Inc.	604.005	1,08
7.900	Facebook Inc. - A	1.013.333	1,80
5.000	Fidelity National Information Services Inc.	385.150	0,69
2.400	Finisar Corp.	71.520	0,13
13.000	Fitbit Inc. - A	192.920	0,34
31.900	Fortinet Inc.	1.178.067	2,10
42.600	Hewlett Packard Enterprise	969.150	1,72
15.000	Integrated Device Technology Inc.	346.500	0,62
9.600	Kla-Tencor Corp.	669.216	1,19
50.912	Lam Research Corp.	4.821.875	8,60
116.201	Lattice Semiconductor Corp.	754.144	1,34
61.853	Lifelock Inc.	1.046.553	1,87
41.232	Maxim Integrated Products Inc.	1.646.394	2,94
21.078	Microsemi Corp.	884.854	1,58
55.394	Nuance Communications Inc.	803.213	1,42
86.400	On Semiconductor Corp.	1.064.448	1,90
14.900	Oracle Corp.	585.272	1,03
5.300	Palo Alto Networks Inc.	844.449	1,51
400	Priceline.Com Inc.	588.596	1,05
45.377	Qorvo Inc.	2.529.314	4,51
5.600	Qualcomm Inc.	383.600	0,68
6.972	Salesforce.com Inc.	497.313	0,89

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Technology

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
21.819	Skyworks Solutions Inc.	1.661.299	2,96
3.700	Splunk Inc.	217.116	0,39
27.247	Synaptics Inc.	1.596.129	2,85
37.990	Synopsys Inc.	2.254.707	4,02
3.615	Tableau Software Inc. - A	199.801	0,36
97.012	Teradyne Inc.	2.093.519	3,73
60.696	Tivo Corp.	1.182.358	2,11
18.900	Visa Inc. - A	1.563.030	2,79
18.000	Western Digital Corp.	1.052.460	1,88
	Summe Vereinigte Staaten	46.232.165	82,42
	Summe Aktien	55.678.524	99,27
	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	55.678.524	99,27
	Wert der Anlagen insgesamt	55.678.524	99,27
(Gesamtkosten: USD 51.358.430)			

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

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BERMUDAS				INDONESIEN			
27.968	Credicorp Limited	4.257.289	1,90	2.774.500	Bank Mandiri Tbk Pt	2.380.921	1,06
	Summe Bermudas	4.257.289	1,90	4.242.500	Bank Rakyat Indonesia	3.965.736	1,77
BRASILIEN				Summe Indonesien		6.346.657	2,83
384.900	Ambev SA - ADR	2.344.041	1,05	KASACHSTAN			
384.792	Cielo SA	3.850.464	1,72	209.628	KazMunaiGas Exploration		
602.600	Companhia de Concessoes				Production - GDR	1.603.654	0,72
	Rodovias	3.142.046	1,40	Summe Kasachstan		1.603.654	0,72
1.205.000	Suzano Papel e Celulose SA	3.883.325	1,74	MALAYSIA			
	Summe Brasilien	13.219.876	5,91	4.688.300	Ambb Holdings Bhd	4.636.723	2,07
KAIMANINSELN				3.277.900	Resorts World Bhd	3.606.447	1,61
3.986.733	Belle International			1.332.500	Tenaga Nasional Bhd	4.607.610	2,06
	Holdings Limited	2.734.594	1,22	Summe Malaysia		12.850.780	5,74
381.000	Hengan International Group			MEXIKO			
	Company Limited	3.158.639	1,41	3.477.575	Fibra Uno Administracion		
698.400	Sands China Limited	3.030.075	1,35		SA de CV	6.364.489	2,84
3.047.000	Want Want China			837.000	Gentera SAB de CV	1.509.348	0,67
	Holdings Limited	1.885.723	0,85	265.682	Grupo Financiero Santander		
6.882.500	WH Group Limited	5.537.260	2,48		Mexico SAB de CV - ADR	2.338.002	1,05
	Summe Kaimaninseln	16.346.291	7,31	508.900	Kimberly-Clark de Mexico		
HONGKONG					SA de CV	1.153.293	0,52
774.500	Beijing Enterprises			Summe Mexiko		11.365.132	5,08
	Holdings Limited	3.924.443	1,75	PHILIPPINEN			
655.500	China Mobile Limited	7.931.788	3,56	116.300	Pldt Inc.	4.148.421	1,85
3.731.499	China Resources Power			Summe Philippinen		4.148.421	1,85
	Holdings Company Limited	6.427.675	2,87	KATAR			
210.000	CSPC Pharmaceutical			26.172	Qatar Electricity &		
	Group Limited	210.109	0,09		Water Company	1.534.243	0,69
	Summe Hongkong	18.494.015	8,27	115.743	Qatar National Bank SAQ		
INDIEN					P.P. 144A	4.957.682	2,23
378.449	Axis Bank Limited	3.077.198	1,38	Summe Katar		6.491.925	2,92
155.723	Bajaj Auto Limited	6.613.642	2,96	SÜDKOREA			
1.753.160	Cairn India Limited	5.267.809	2,35	28.092	Hyundai Mobis	7.014.418	3,14
303.751	HCL Technologies Limited	3.649.416	1,63	7.340	Samsung Electronics		
220.319	Housing Development				Company Limited	10.649.988	4,77
	Finance Corp.	4.611.193	2,06	38.240	SK Telecom Company Limited	7.846.981	3,51
29.500	Infosys Technologies			Summe Südkorea		25.511.387	11,42
	Limited - ADR	465.510	0,21				
121.157	Infosys Technologies Limited	1.885.381	0,84				
138.921	Larsen & Toubro Limited	2.990.401	1,34				
	Summe Indien	28.560.550	12,77				

*Siehe Erläuterung 20.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

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

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Aktien (Fortsetzung)			
RUSSISCHE FÖDERATION				VEREINIGTES KÖNIGREICH			
774.688	Gazprom OAO - ADR	3.261.436	1,45	96.989	Unilever plc	4.604.257	2,05
48.937	Lukoil PJSC - ADR	2.382.743	1,07		Summe Vereinigtes Königreich	4.604.257	2,05
	Summe Russische Föderation	5.644.179	2,52				
SÜDAFRIKA				VEREINIGTE STAATEN			
146.943	Bidvest Group Limited	1.726.618	0,77	98.590	Abbott Laboratories	4.169.371	1,87
2.242.890	Growthpoint Properties Limited	4.128.193	1,85		Summe Vereinigte Staaten	4.169.371	1,87
275.000	Mtn Group Limited	2.348.997	1,05		Summe Aktien	220.459.985	98,58
760.352	Woolworths Holdings Limited	4.273.639	1,91		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	220.459.985	98,58
	Summe Südafrika	12.477.447	5,58		Wert der Anlagen insgesamt	220.459.985	98,58
SCHWEIZ					(Gesamtkosten: USD 239.510.798)		
422.431	Compagnie Financiere Richemont SA	2.559.557	1,14				
	Summe Schweiz	2.559.557	1,14				
TAIWAN							
581.000	Asustek Computer Inc.	5.180.712	2,32				
592.000	MediaTek Inc.	4.523.335	2,02				
7.615.383	Mega Financial Holding Company Limited	5.357.126	2,40				
1.766.000	Taiwan Mobile Company Limited	6.338.329	2,83				
1.549.214	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	9.019.985	4,03				
	Summe Taiwan	30.419.487	13,60				
THAILAND							
518.300	Kasikornbank plc - NVDR	2.804.651	1,25				
	Summe Thailand	2.804.651	1,25				
TÜRKEI							
79.893	Tupras-Türkiye Petrol Rafinerileri	1.512.290	0,68				
1.380.996	Türk Telekomunikasyon AS	2.609.477	1,17				
	Summe Türkei	4.121.767	1,85				
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE							
6.027.085	Emaar Malls Group PJSC	4.463.292	2,00				
	Summe Vereinigte Arabische Emirate	4.463.292	2,00				

*Siehe Erläuterung 20.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - UK Equities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Anzahl	Anlage	Marktwert GBP	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert GBP	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
IRLAND				VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)			
107.874	CRH plc	2.763.731	2,08	875.201	Melrose Industries plc	1.527.226	1,15
	Summe Irland	2.763.731	2,08	405.948	Merlin Entertainments plc	1.784.547	1,34
JERSEY - KANALINSELN				160.190	Pearson plc	1.206.231	0,91
1.730.960	Breedon Aggregates Limited	1.228.982	0,92	306.001	Prudential plc	4.181.504	3,14
63.045	Wolseley plc	2.745.609	2,06	239.085	PZ Cussons plc	869.313	0,65
	Summe Jersey - Kanalinseln	3.974.591	2,98	45.043	Reckitt Benckiser Group plc	3.272.374	2,46
VEREINIGTES KÖNIGREICH				233.855	Reed Elsevier plc	3.421.298	2,57
34.461	Aggreko plc	328.586	0,25	737.474	Rentokil Initial plc	1.639.405	1,23
82.300	Astrazeneca plc	4.118.293	3,10	112.450	Rio Tinto plc	2.895.025	2,18
361.865	BAE Systems plc	1.896.172	1,42	171.313	Rolls-Royce Holdings plc	1.233.454	0,93
525.236	Barclays plc	881.346	0,66	345.054	Royal & Sun Alliance	1.883.995	1,42
49.870	Bellway plc	1.181.420	0,89	263.556	Royal Dutch Shell plc - B	5.263.213	3,96
149.369	Berendsen plc	1.858.150	1,40	319.240	Royal Mail plc	1.562.680	1,18
696.418	Booker Group plc	1.239.624	0,93	343.143	Sage Group plc	2.532.395	1,90
77.434	British American Tobacco plc	3.817.496	2,87	65.071	Schroders plc	1.318.338	0,99
1.201.149	BT Group plc	4.673.070	3,51	260.728	Smith & Nephew plc	3.243.456	2,44
101.434	Burberry Group plc	1.398.775	1,05	127.519	Smiths Group plc	1.866.878	1,40
53.590	Carnival plc	2.019.272	1,52	251.891	St James's Place plc	2.387.927	1,79
173.564	Compass Group plc	2.594.782	1,95	468.353	Stagecoach Group plc	989.630	0,74
508.899	Crest Nicholson Holdings plc	2.296.661	1,72	204.054	Standard Chartered Bank plc	1.282.071	0,97
310.916	Daily Mail & General Trust plc	2.314.770	1,74	31.360	Ultra Electronics Holdings plc	556.013	0,42
40.495	Derwent London plc	1.053.275	0,79	114.363	Unilever plc	4.179.396	3,14
164.277	Diageo plc	3.631.343	2,73		Summe Vereinigtes Königreich	125.068.585	94,01
370.546	Ds Smith plc	1.424.008	1,07	Summe Aktien		131.806.907	99,07
280.031	Fdm Group Holdings plc	1.713.790	1,29	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind		131.806.907	99,07
145.332	Filtrona plc	706.168	0,53	Wert der Anlagen insgesamt		131.806.907	99,07
883.112	GKN plc	2.828.608	2,13	(Gesamtkosten: GBP 114.835.523)			
248.044	Glaxosmithkline plc	4.075.363	3,06				
501.936	Grainger plc	1.154.453	0,87				
135.151	Greene King plc	1.046.068	0,79				
139.448	Headlam Group plc	688.873	0,52				
153.746	Howden Joinery Group plc	664.644	0,50				
114.855	Hunting plc	526.495	0,40				
127.137	Imperial Tobacco Group plc	5.051.790	3,80				
123.466	Inchcape plc	813.024	0,61				
83.623	Intercontinental Hotels Group plc	2.659.211	2,00				
107.473	Intermediate Capital Group plc	634.091	0,48				
1.219.037	Itv plc	2.282.037	1,71				
84.979	JD Wetherspoon plc	799.228	0,60				
385.472	John Wood Group plc	2.927.660	2,20				
80.900	Johnson Matthey plc	2.664.846	2,00				
119.767	Land Securities Group plc	1.267.135	0,95				
1.473.996	Legal & General Group plc	3.223.629	2,42				
125.645	London Stock Exchange Group plc	3.518.060	2,64				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
ÄGYPTEN				VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE			
214.000	Commercial International Bank	1.159.170	8,85	37.400	Orascom Construction Limited	298.064	2,28
136.500	Credit Agricole	362.157	2,76		Summe Vereinigte Arabische Emirate	298.064	2,28
162.197	Edita Food Industries	174.801	1,33				
513.000	Egyptian Financial Group-Hermes Holding - H	720.397	5,51	Summe Aktien		11.280.259	86,21
553.000	Juhayna Food Industries	256.573	1,96	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind		11.280.259	86,21
333.000	Oriental Weavers	289.876	2,22				
577.000	Talaat Moustafa Group	350.880	2,68				
	Summe Ägypten	3.313.854	25,31				
KENIA				Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
1.980.000	Co-Operative Bank of Kenya Limited	241.522	1,85	Aktien			
336.000	East African Breweries Limited	922.591	7,05	TANSANIA			
1.419.992	Equity Bank Limited	431.277	3,30	80.000	Tanzania Breweries Limited	477.360	3,65
1.654.273	Kenya Commercial Bank Limited	457.499	3,50		Summe Tansania	477.360	3,65
5.160.000	Safaricom Limited	1.016.758	7,77				
	Summe Kenia	3.069.647	23,47	SIMBABWE			
MAURITIUS				193.596	Afrasia Zimbabwe Holdings Limited*	0	0,00
100.000	MCB Group Limited	622.889	4,76		Summe Simbabwe	0	0,00
	Summe Mauritius	622.889	4,76	Summe Aktien		477.360	3,65
MAROKKO				Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		477.360	3,65
8.000	Attijariwafa Bank	292.475	2,24	Wert der Anlagen insgesamt		11.757.619	89,86
83.000	Maroc Telecom	1.089.949	8,33	(Gesamtkosten: USD 14.685.150)			
	Summe Marokko	1.382.424	10,57	<i>* Illiquides Wertpapier.</i>			
NIGERIA							
800.000	Dangote Cement plc	464.820	3,55				
7.810.000	Guaranty Trust Bank plc	595.121	4,55				
22.353	Nestle Nigeria plc	58.551	0,45				
1.165.000	Nigerian Breweries plc	554.831	4,24				
161.547.689	Standard Alliance Insurance*	0	0,00				
8.132.000	Zenith Bank plc	392.709	3,00				
	Summe Nigeria	2.066.032	15,79				
UGANDA							
3.405.000	Umeme Limited	527.349	4,03				
	Summe Uganda	527.349	4,03				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - STANLIB Global Emerging Markets Property Securities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BRASILIEN				MALAYSIA			
2.743	Aliansce Shopping Centers SA	13.044	0,19	174.181	Capitamalls Malaysia Trust	65.284	0,94
5.444	BR Malls Participacoes SA	20.611	0,30	67	Mah Sing Group Bhd	26	0,00
3.830	Iguatemi Empresa de Shopping Centers SA	35.013	0,50	66.336	Sunway Bhd	49.726	0,72
2.750	Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA	53.496	0,77	Summe Malaysia		115.036	1,66
Summe Brasilien		122.164	1,76	MAURITIUS			
KAIMANINSELN				16.956	Rockcastle Global Real Estat	43.774	0,63
219.882	China Resources Land Limited	612.361	8,82	Summe Mauritius		43.774	0,63
131.626	KWG Property Holding Limited	86.382	1,25	MEXIKO			
66.560	Longfor Properties Company Limited	102.123	1,47	72.785	Corporacion Inmobiliaria Vesta SAB de CV	100.601	1,45
49.483	Shimao Property Holdings Limited	66.990	0,97	138.463	Fibra Uno Administracion SA de CV	253.409	3,64
Summe Kaimaninseln		867.856	12,51	89.084	Prologis Property Mexico SA de CV	146.190	2,11
CHINA				139.598	TF Administradora Industrial S de RL de CV	231.539	3,34
222.091	Beijing Capital International Airport Company Limited - H	251.700	3,63	Summe Mexiko		731.739	10,54
55.884	China Vanke Company Limited - H	144.826	2,09	PHILIPPINEN			
Summe China		396.526	5,72	405.489	Ayala Land Inc.	328.192	4,73
ÄGYPTEN				3.872.852	Filinvest Land Inc.	146.148	2,11
312.428	Emaar Misr for Development SAE	78.811	1,14	392.385	Robinsons Land Corp.	250.833	3,62
Summe Ägypten		78.811	1,14	819.307	Sm Prime Holdings Inc.	475.592	6,86
HONGKONG				Summe Philippinen		1.200.765	17,32
323.057	China Jinmao Holdings Group Limited	99.550	1,44	SINGAPUR			
187.990	China Overseas Land & Investment Limited	637.462	9,18	277.480	Ascendas India Trust	219.794	3,17
Summe Hongkong		737.012	10,62	86.545	Capitaretail China Trust	102.512	1,48
INDONESIEN				88.432	First Real Estate Investment Trust	87.884	1,27
211.727	Bumi Serpong Damai Pt	35.690	0,51	92.600	Global Logistic Properties Limited	127.003	1,83
2.881.036	Pakuwon Jati Tbk Pt	149.003	2,15	435.018	Lippo Malls Indonesia Retail Trust	119.646	1,73
Summe Indonesien		184.693	2,66	Summe Singapur		656.839	9,48

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - STANLIB Global Emerging Markets Property Securities

Aufstellung der Wertpapieranlage

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien (Fortsetzung)				Fonds			
SÜDAFRIKA				ISLE OF MAN			
52.751	Attacq Limited	66.134	0,95	14.024	New Europe Property Investments plc	158.585	2,29
56.727	Balwin Properties Pty Limited	32.177	0,46		Summe Isle of Man	158.585	2,29
57.188	Fortress Income Fund Limited	67.580	0,97				
60.589	Growthpoint Properties Limited	111.518	1,61		Summe Fonds	158.585	2,29
10.261	Hyprop Investments Limited	90.162	1,30				
110.587	Redefine Income Fund Limited	91.920	1,33		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	6.942.122	100,09
24.093	Resilient REIT Limited	200.857	2,90		Wert der Anlagen insgesamt	6.942.122	100,09
	Summe Südafrika	660.348	9,52		(Gesamtkosten: USD 6.878.866)		
THAILAND							
135.229	Central Pattana pcl	225.381	3,25				
303.104	Land & Houses pcl	84.852	1,22				
333.586	Ticon Industrial Connection pcl	153.074	2,21				
	Summe Thailand	463.307	6,68				
TÜRKEI							
1	Is Gayrimenkul Yatirim Ortakligi AS	0	0,00				
	Summe Türkei	0	0,00				
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE							
113.087	Emaar Malls Group PJSC	83.745	1,21				
228.072	Emaar Properties PJSC	440.869	6,35				
	Summe Vereinigte Arabische Emirate	524.614	7,56				
Summe Aktien		6.783.484	97,80				
Rechte							
BRASILIEN							
397	Aliansce Shopping Center Right	53	0,00				
	Summe Brasilien	53	0,00				
Summe Rechte		53	0,00				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BERMUDAS				VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)			
14.460	IHS Markit Limited	542.973	0,33	6.672	Merck & Company Inc.	416.400	0,25
	Summe Bermudas	542.973	0,33	10.806	Metlife Inc.	480.111	0,29
IRLAND				6.063	Molson Coors Brewing Company	665.717	0,41
19.348	Medtronic Inc.	1.671.667	1,01	11.491	MSCI Inc. - A	964.555	0,58
	Summe Irland	1.671.667	1,01	24.844	Newell Rubbermaid Inc.	1.308.286	0,79
SCHWEIZ				15.811	Newmont Mining Corp.	621.214	0,38
5.094	Chubb Limited	640.061	0,39	10.929	Norfolk Southern Corp.	1.060.768	0,65
	Summe Schweiz	640.061	0,39	38.007	Nutanix Inc. - A Ntnx Us	1.406.259	0,85
VEREINIGTE STAATEN				10.720	Parametric Technology Corp.	475.003	0,29
9.311	Adobe Systems Inc.	1.010.615	0,61	12.992	Phillips 66	1.046.506	0,63
7.464	Align Technology Inc.	699.750	0,42	12.209	Qualcomm Inc.	836.317	0,51
4.830	Alphabet Inc. - A	3.883.610	2,35	8.866	Quintiles Transnational Holdings Inc.	718.678	0,43
1.127	Amazon.com Inc.	943.649	0,57	7.300	Realogy Holdings Corp.	188.778	0,11
32.755	Analog Devices Inc.	2.111.060	1,28	70.092	Rite Aid Corp.	539.007	0,33
18.228	Apple Computer Company	2.060.675	1,25	5.511	Salesforce.com Inc.	393.100	0,24
22.591	Berkshire Hathaway Inc.	3.263.721	1,97	6.839	Union Pacific Corp.	667.008	0,40
2.780	Biogen Idec Inc.	870.223	0,52	10.229	United Health Group Inc.	1.432.060	0,87
4.319	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	399.594	0,24	10.047	Universal Display Corp.	557.709	0,34
2.400	Bluebird Bio Inc.	162.672	0,10	5.727	Valspar Corp.	607.463	0,37
10.173	Bristol-Myers Squibb Company	548.528	0,34	14.358	Valvoline Inc.	337.269	0,20
2.540	Charter Communications Inc.	685.724	0,41	7.966	Verizon Communications Inc.	414.073	0,25
10.559	Cigna Corp.	1.376.049	0,83	25.496	Visa Inc. - A	2.108.519	1,27
2.747	Clorox Company	343.869	0,21	8.800	Yum Brands	799.127	0,49
736	Constellation Brands	122.537	0,07		Summe Vereinigte Staaten	54.751.228	33,12
4.141	Costco Wholesale Corp.	631.544	0,38	Summe Aktien		57.605.929	34,85
18.699	Devon Energy Corp.	824.813	0,50	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind		57.605.929	34,85
31.192	Dollar General Corp.	2.183.129	1,31	Wert der Anlagen insgesamt		57.605.929	34,85
15.494	Dow Chemical Company	803.054	0,49	(Gesamtkosten: USD 51.982.280)			
4.344	Edwards Lifesciences Corp.	523.713	0,32				
10.850	Electronic Arts Inc.	926.590	0,56				
1.692	General Dynamics Corp.	262.531	0,16				
4.093	Gilead Sciences Inc.	323.838	0,20				
3.992	Home Depot Inc.	513.691	0,31				
1.480	Honeywell International Inc.	172.553	0,10				
5.174	Humana Inc.	915.229	0,55				
591	IntercontinentalExchange Inc.	159.192	0,10				
12.465	JPMorgan Chase & Company	830.044	0,50				
40.994	Lam Research Corp.	3.882.542	2,35				
10.255	Leidos Holdings Inc.	443.836	0,27				
4.393	Linkedin Corp.	839.590	0,51				
2.823	Lockheed Martin Corp.	676.729	0,41				
109.871	Marathon Oil Corp.	1.737.060	1,05				
11.724	Marriott International Inc.	789.377	0,48				
7.723	Mastercard Inc. - A	785.970	0,47				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia*

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
VEREINIGTE STAATEN				
USD	1.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 06/10/2016	999.993	10,13
USD	1.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 13/10/2016	999.959	10,13
USD	1.100.000	United States Treasury Bill 0.00% 20/10/2016	1.099.945	11,13
USD	1.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 10/11/2016	999.823	10,13
		Summe Vereinigte Staaten	4.099.720	41,52
Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente			4.099.720	41,52
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind			4.099.720	41,52

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	1.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 27/10/2016	999.875	10,12
USD	1.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 03/11/2016	999.847	10,13
USD	1.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 17/11/2016	999.803	10,13
USD	1.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 25/11/2016	999.790	10,13
USD	1.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 01/12/2016	999.750	10,13
		Summe Vereinigte Staaten	4.999.065	50,64
Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente			4.999.065	50,64
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt			4.999.065	50,64
Wert der Anlagen insgesamt			9.098.785	92,16
(Gesamtkosten: USD 9.096.421)				

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen					Anleihen (Fortsetzung)				
AUSTRALIEN					IRLAND				
EUR	210.000	Aurizon Network Pty Limited 2.00% 18/09/2024	248.611	0,57	EUR	118.000	Allied Irish Banks FRN 26/11/2025	128.167	0,29
EUR	140.000	BHP Billiton Finance Limited FRN 22/10/2079	178.121	0,41	EUR	265.000	Ardagh Packaging Finance plc 4.25% 15/01/2022	304.996	0,69
USD	200.000	SGSP Australia Assets Pty Limited 3.25% 29/07/2026	204.311	0,46	EUR	200.000	Bank of Ireland FRN 29/12/2049	215.268	0,49
EUR	400.000	SGSP Australia Assets Pty Limited 2.00% 30/06/2022	487.777	1,11	USD	410.000	Vnesheconombank Via Veb Finance plc 5.94% 21/11/2023	434.326	0,99
USD	285.000	Woodside Finance Limited 3.65% 05/03/2025	288.562	0,66			Summe Irland	1.082.757	2,46
		Summe Australien	1.407.382	3,21	ITALIEN				
ÖSTERREICH					EUR	239.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3.63% 01/04/2019	262.660	0,60
EUR	200.000	Bawag PSK 8.13% 30/10/2023	283.801	0,65	EUR	122.000	Enel SpA FRN 15/01/2075	146.238	0,33
USD	200.000	Erste Group Bank FRN 26/05/2025	206.712	0,47			Summe Italien	408.898	0,93
		Summe Österreich	490.513	1,12	JAPAN				
KAIMANINSELN					EUR	170.000	Softbank Group Corp 4.00% 30/07/2022	206.850	0,47
USD	173.000	Noble Holding International Limited 5.25% 15/03/2042	100.443	0,23			Summe Japan	206.850	0,47
USD	305.000	Noble Holding International Limited 6.95% 01/04/2045	214.934	0,49	JERSEY - KANALINSELN				
GBP	346.000	Thames Water Utilities Cayman Finance Limited FRN 21/07/2025	463.331	1,05	GBP	180.000	Cpuk Finance Limited 7.00% 28/02/2042	247.763	0,56
GBP	156.000	Yorkshire Water FRN 24/04/2025	207.618	0,47	GBP	150.000	Tvl Finance plc 8.50% 15/05/2023	205.567	0,47
		Summe Kaimaninseln	986.326	2,24			Summe Jersey - Kanalinseln	453.330	1,03
FRANKREICH					LUXEMBURG				
USD	280.000	Credit Agricole SA FRN 19/09/2033	303.435	0,69	EUR	147.000	Altice SA 6.25% 15/02/2025	166.479	0,38
EUR	170.000	Numericable Group SA 5.38% 15/05/2022	197.835	0,45	EUR	155.000	Altice SA 7.25% 15/05/2022	184.083	0,42
		Summe Frankreich	501.270	1,14	EUR	190.000	Cirsa Funding Lux 5.75% 15/05/2021	225.084	0,51
GEORGIEN					USD	200.000	Gazprom OAO via Gaz Capital SA 6.00% 23/01/2021	217.572	0,50
USD	469.000	Georgian Railway JSC 7.75% 11/07/2022	530.240	1,21	EUR	300.000	Grand City Properties 1.50% 17/04/2025	348.279	0,79
		Summe Georgien	530.240	1,21	EUR	140.000	Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	163.724	0,37
ISLAND							Summe Luxemburg	1.305.221	2,97
EUR	220.000	Arion Banki hf 2.50% 26/04/2019	256.198	0,58	MEXIKO				
		Summe Island	256.198	0,58	USD	720.000	Petroleos Mexicanos 5.50% 04/02/2019	761.673	1,73
							Summe Mexiko	761.673	1,73

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	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Anleihen (Fortsetzung)				
NIEDERLANDE					VEREINIGTES KÖNIGREICH				
EUR	165.000	Eneco Holding NV FRN 29/12/2049	191.455	0,44	GBP	70.021	Aspire Defence 4.67% 31/03/2040	115.645	0,26
EUR	130.000	LGE Holdco VI BV 7.13% 15/05/2024	163.343	0,37	GBP	135.000	Barclays Bank 10.00% 21/05/2021	226.481	0,52
GBP	14.000	Munich Re Finance FRN 21/06/2028	19.918	0,05	USD	211.000	BG Energy Capital plc FRN 30/11/2072	220.932	0,50
GBP	132.000	Postnl NV 7.50% 14/08/2018	192.918	0,44	GBP	18.264	Canary Wharf Finance II plc 6.46% 22/04/2030	36.417	0,08
GBP	64.000	RWE Finance BV 6.25% 03/06/2030	113.347	0,26	GBP	175.000	G4s plc 7.75% 13/05/2019	261.232	0,60
EUR	92.250	Schaeffler Holding Finance BV 6.88% 15/08/2018	105.683	0,24	GBP	162.000	GKN Holdings plc 6.75% 28/10/2019	243.502	0,56
EUR	144.000	SNS Bank NV FRN 05/11/2025	165.190	0,38	GBP	98.967	Greene King Finance 4.06% 15/03/2035	142.353	0,33
GBP	200.000	Telefonica Europe BV FRN 26/11/2049	278.630	0,64	GBP	65.000	HSBC Bank plc FRN 20/03/2023	88.141	0,20
EUR	190.000	Vesteda Finance BV 2.50% 27/10/2022	235.546	0,54	GBP	100.000	HSBC Holdings plc FRN 18/10/2022	135.651	0,31
EUR	100.000	Vonovia Finance BV FRN 29/12/2049	119.299	0,27	GBP	105.000	Lloyds Banking Group plc FRN 31/12/2049	142.230	0,32
EUR	200.000	Vonovia Finance BV FRN 08/04/2074	238.347	0,54	EUR	226.000	Merlin Entertainments plc 2.75% 15/03/2022	261.812	0,60
EUR	100.000	Ziggo Secured Finance BV 3.75% 15/01/2025	112.871	0,26	EUR	100.000	National Grid Gas 0.63% 22/09/2024	113.385	0,26
		Summe Niederlande	1.936.547	4,43	GBP	100.000	National Grid Gas 2.13% 22/09/2028	134.051	0,31
					GBP	100.000	National Grid Gas 2.63% 22/09/2038	135.483	0,31
PORTUGAL					GBP	100.000	National Grid Gas 2.75% 22/09/2046	135.549	0,31
EUR	600.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2019	155.084	0,35	GBP	250.000	Pennon Group plc FRN 08/03/2049	340.435	0,78
		Summe Portugal	155.084	0,35	USD	130.000	Royal Bank of Scotland 6.13% 15/12/2022	138.023	0,31
SCHWEDEN					USD	200.000	Royal Bank of Scotland 8.63% 29/12/2049	198.109	0,45
EUR	100.000	Atlas Copco AB 0.63% 30/08/2026	112.996	0,26	GBP	122.000	Safeway Limited 6.00% 10/01/2017	160.429	0,37
		Summe Schweden	112.996	0,26	USD	200.000	Standard Chartered 4.05% 12/04/2026	206.941	0,47
SCHWEIZ					GBP	74.500	Telereal 4.97% 10/09/2027	111.719	0,25
EUR	480.000	Credit Suisse AG FRN 18/09/2025	587.509	1,35	GBP	365.865	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	481.385	1,10
EUR	250.000	UBS AG FRN 12/02/2026	300.313	0,69	GBP	200.000	Tsb Banking Group plc 5.75% 06/05/2026	274.444	0,63
USD	200.000	UBS Group AG FRN 29/12/2049	211.998	0,48	GBP	210.000	Virgin Media Finance 6.38% 15/10/2024	284.984	0,65
		Summe Schweiz	1.099.820	2,52	GBP	100.000	Western Power Distribution 3.63% 06/11/2023	144.492	0,33
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE					GBP	125.000	WM Morrison Supermarkets plc 4.63% 08/12/2023	185.612	0,42
EUR	200.000	Emirates NBD PJSC 1.75% 23/03/2022	226.440	0,52			Summe Vereinigtes Königreich	4.919.437	11,23
		Summe Vereinigte Arabische Emirate	226.440	0,52					

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	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Anleihen (Fortsetzung)					Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen				
VEREINIGTE STAATEN					AUSTRALIEN				
USD	90.000	Aetna Inc. 4.38% 15/06/2046	93.993	0,21	EUR	42.269	Firstmac Bond Trust FRN 15/08/2037	47.472	0,11
GBP	100.000	American International Group Inc. 5.00% 26/04/2023	151.663	0,35			Summe Australien	47.472	0,11
USD	205.000	Cimarex Energy Company 4.38% 01/06/2024	215.124	0,49					
USD	210.000	Columbia Pipeline Group Inc. 4.50% 01/06/2025	229.403	0,52	DEUTSCHLAND				
USD	175.000	Continental Resources Inc. 5.00% 15/09/2022	175.309	0,40	EUR	108.000	Unitymedia Hessen 5.63% 15/04/2023	128.976	0,29
EUR	200.000	Digital Euro Finco LLC 2.63% 15/04/2024	239.512	0,55	EUR	81.000	Unitymedia Hessen Gmbh & Company 5.13% 21/01/2023	95.820	0,22
USD	110.000	Hartford FRN 15/06/2038	120.464	0,27			Summe Deutschland	224.796	0,51
GBP	115.000	HJ Heinz Company 4.13% 01/07/2027	174.971	0,40	VEREINIGTES KÖNIGREICH				
USD	418.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 4.25% 01/09/2024	432.314	0,99	GBP	55.637	Telereal 5.43% 10/12/2031	83.207	0,19
EUR	100.000	Kinder Morgan Inc. 2.25% 16/03/2027	113.694	0,26			Summe Vereinigtes Königreich	83.207	0,19
EUR	174.000	Liberty Mutual Group 2.75% 04/05/2026	211.362	0,47			Summe Forderungs- und hypothekenbesicherte Wertpapiere	355.475	0,81
USD	81.000	Loews Corp 3.75% 01/04/2026	86.117	0,20	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
EUR	100.000	Molson Coors Brewing Company 1.25% 15/07/2024	115.895	0,26	ARGENTINIEN				
USD	210.000	Molson Coors Brewing Company 5.00% 01/05/2042	243.795	0,56	USD	300.000	Argentina (Govt of) 7.50% 22/04/2026	338.831	0,77
USD	336.000	Plains All American Pipeline LP 4.65% 15/10/2025	348.812	0,79			Summe Argentinien	338.831	0,77
USD	130.000	Prudential Financial Inc. FRN 15/06/2038	144.211	0,33	AUSTRALIEN				
USD	114.000	Scripps Networks 3.95% 15/06/2025	120.496	0,27	AUD	2.400.000	Australia (Govt of) 1.75% 21/11/2020	1.850.062	4,21
USD	145.000	Scripps Networks Interactive Inc. 2.80% 15/06/2020	148.554	0,34	AUD	2.100.000	Australian (Govt of) 2.75% 21/10/2019	1.665.641	3,80
EUR	165.000	Sealed Air Corp 4.50% 15/09/2023	204.991	0,47			Summe Australien	3.515.703	8,01
USD	211.000	Verizon Communications Inc. 5.01% 21/08/2054	233.763	0,53	KANADA				
USD	245.000	Williams Partners LP 4.90% 15/01/2045	234.154	0,53	CAD	2.180.000	Canadian (Govt of) 1.50% 01/06/2026	1.735.963	3,96
Summe Vereinigte Staaten			4.038.597	9,19			Summe Kanada	1.735.963	3,96
BRITISCHE JUNGFERNINSELN					KROATIEN				
GBP	180.000	Global Switch Holdings Limited 4.38% 13/12/2022	264.190	0,60	USD	540.000	Croatia (Govt of) 6.00% 26/01/2024	621.605	1,42
Summe Britische Jungferninseln			264.190	0,60			Summe Kroatien	621.605	1,42
Summe Anleihen			21.143.769	48,19					

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	Nennwert		Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)					Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)				
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)					Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)				
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					SCHWEDEN				
USD	550.000	Dominican (Govt of) 7.50% 06/05/2021	616.424	1,40	USD	210.000	Swedish Export Credit FRN 14/11/2023	210.866	0,48
		Summe Dominikanische Republik	616.424	1,40			Summe Schweden	210.866	0,48
UNGARN					Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
HUF	455.000.000	Hungary (Govt of) 5.50% 24/06/2025	2.013.055	4,59				16.276.030	37,10
USD	545.000	Mfb Magyar Fejlesztési Bank Zrt 6.25% 21/10/2020	617.989	1,41	Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				
		Summe Ungarn	2.631.044	6,00				37.775.274	86,10
INDONESIEN					Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt				
USD	560.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 08/01/2026	627.304	1,43	Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
IDR	12.891.000.000	Indonesia (Govt of) 8.75% 15/05/2031	1.118.708	2,55	RUSSISCHE FÖDERATION				
		Summe Indonesien	1.746.012	3,98	RUB	236.190.000	Russia (Govt of) 7.50% 18/08/2021	3.642.211	8,29
ITALIEN							Summe Russische Föderation	3.642.211	8,29
EUR	1.272.000	Italy (Govt of) BPT 2.70% 01/03/2047	1.577.639	3,60	Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente				
		Summe Italien	1.577.639	3,60				3.642.211	8,29
ELFENBEINKÜSTE					Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt				
USD	450.000	Ivory Coast (Govt of) 5.38% 23/07/2024	453.371	1,03				3.642.211	8,29
		Summe Elfenbeinküste	453.371	1,03	Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				
PORTUGAL					Anleihen				
EUR	1.880.000	Portugal (Govt of) OT 3.88% 15/02/2030	2.127.849	4,85	AUSTRALIEN				
		Summe Portugal	2.127.849	4,85	USD	90.000	Asciano Finance Limited 5.00% 07/04/2018	93.295	0,21
RUSSISCHE FÖDERATION							Summe Australien	93.295	0,21
RUB	43.673.000	Russian Federal Bond - Ofz 8.15% 03/02/2027	700.723	1,60	NIEDERLANDE				
		Summe Russische Föderation	700.723	1,60	USD	220.000	Deutsche Annington Finance BV 3.20% 02/10/2017	222.694	0,51
							Summe Niederlande	222.694	0,51

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
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente (Fortsetzung)			
Anleihen (Fortsetzung)			
VEREINIGTE STAATEN			
USD	120.000 Massachusetts Mutual Life Insurance Company P.P. 144A 4.50% 15/04/2065	118.331	0,27
	Summe Vereinigte Staaten	118.331	0,27
	Summe Anleihen	434.320	0,99
Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen			
AUSTRALIEN			
AUD	666.377 TRTN FRN 20/03/2043	508.374	1,16
	Summe Australien	508.374	1,16
	Summe Forderungs- und hypothekenbesicherte Wertpapiere	508.374	1,16
	Summe Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	942.694	2,15
Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren			
Fonds			
LUXEMBURG			
43.705	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond Portfolio	1.365.777	3,11
	Summe Luxemburg	1.365.777	3,11
	Summe Fonds	1.365.777	3,11
	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren	1.365.777	3,11
	Wert der Anlagen insgesamt	43.725.956	99,65
(Gesamtkosten: USD 44.527.224)			

Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha*

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind				Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind (Fortsetzung)			
Aktien				Aktien (Fortsetzung)			
BELGIEN				SCHWEDEN			
2.956	Anheuser-Busch InBev NV	344.670	2,03	6.439	Atlas Company AB - B	172.745	1,02
	Summe Belgien	344.670	2,03		Summe Schweden	172.745	1,02
DÄNEMARK				SCHWEIZ			
18.934	Tryg A/S	338.187	1,99	33	Lindt & Spruengli AG	170.087	1,00
	Summe Dänemark	338.187	1,99	117	Sika AG	507.345	2,98
FINNLAND					Summe Schweiz	677.432	3,98
5.599	Kone Oyj	252.907	1,48		Summe Aktien	6.352.687	37,34
8.491	Sampo OYJ - A	336.244	1,98		Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind	6.352.687	37,34
	Summe Finnland	589.151	3,46		Wert der Anlagen insgesamt	6.352.687	37,34
FRANKREICH					(Gesamtkosten: EUR 6.341.322)		
5.617	Amundi SA	261.191	1,53				
5.490	Dassault Systemes SA	423.993	2,49				
920	Iliad SA	171.856	1,01				
3.241	Legrand SA	170.088	1,00				
7.724	Schneider Electric SA	479.351	2,82				
	Summe Frankreich	1.506.479	8,85				
DEUTSCHLAND							
23.122	Deutsche Telekom AG - Reg	344.980	2,03				
2.156	Fresenius Medical Care AG & Company KGaA	167.651	0,98				
	Summe Deutschland	512.631	3,01				
ITALIEN							
41.767	Davide Campari-Milano SpA	418.923	2,46				
	Summe Italien	418.923	2,46				
LUXEMBURG							
1.236	Eurofins Scientific	499.776	2,94				
	Summe Luxemburg	499.776	2,94				
NIEDERLANDE							
2.692	ASML Holding NV	262.981	1,55				
	Summe Niederlande	262.981	1,55				
SPANIEN							
15.439	Amadeus IT Holding SA - A	686.573	4,03				
21.313	Cellnex Telecom SAU	343.139	2,02				
	Summe Spanien	1.029.712	6,05				

*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

Aufstellung der Wertpapieranlage

zum 30. September 2016

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind			
Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente			
VEREINIGTE STAATEN			
USD 51.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 30/03/2017	51.389.869	13,32
	Summe Vereinigte Staaten	51.389.869	13,32
Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente		51.389.869	13,32
Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse notiert sind		51.389.869	13,32

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 51.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 27/10/2016	51.493.562	13,35
USD 51.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 25/11/2016	51.489.196	13,34
USD 51.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 29/12/2016	51.466.707	13,34
USD 51.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 26/01/2017	51.456.815	13,33
USD 51.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 09/02/2017	51.439.563	13,33
USD 46.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 23/02/2017	46.438.585	12,03
	Summe Vereinigte Staaten	303.784.428	78,72
Summe Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente		303.784.428	78,72
Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere insgesamt		303.784.428	78,72
Wert der Anlagen insgesamt		355.174.297	92,04
(Gesamtkosten: USD 354.865.043)			

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 in der jeweils gültigen Fassung über Organismen für gemeinsame Anlagen (das „Gesetz vom 17. Dezember 2010“ in seiner jeweils gültigen Fassung) unterliegt.

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 Anteilsklassen (die „Anteilsklassen“) haben. Die SICAV als Gesamtheit, einschließlich aller vorhandenen und zukünftigen Portfolios, stellt einen einzigen Rechtsträger dar. Im Hinblick auf Dritte und insbesondere gegenüber Gläubigern der SICAV und zwischen den Anteilhabern ist jedes Portfolio ausschließlich für die eigenen Verbindlichkeiten verantwortlich.

Wesentliche Ereignisse während des Jahres:

Die Anschrift von Threadneedle Management Luxembourg S.A., der Verwaltungsgesellschaft und der Vertriebsstelle der SICAV, hat sich mit Wirkung zum 15. August 2016 geändert.

Mit Wirkung zum 1. Juli 2016 wurden die Gebühren für bestimmte Portfolios gesenkt. Weitere Informationen finden Sie in Erläuterung 5.

Neue Verkaufsprospekte

Im Juli und September 2016 wurden neue Verkaufsprospekte veröffentlicht.

Änderungen der Anlagepolitik der Portfolios und Namensänderungen

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

Mit Wirkung zum 3. Mai 2016 wurde der Name des Threadneedle (Lux) - US High Income Bonds Portfolios in Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond geändert.

Auflegung und Schließung von Portfolios

Das Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond Portfolio wurde am 5. August 2016 aufgelegt.

Das Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia Portfolio wurde am 20. Juli 2016 aufgelegt.

Das Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha Portfolio wurde am 21. September 2016 aufgelegt.

Mit Wirkung zum 16. August 2016 wurde für das Threadneedle (Lux) - Global Equities - Walter Scott & Partners Portfolio ein Liquidationsverfahren eingeleitet.

Auflegung und Schließung von Anteilsklassen

Während des Geschäftsjahrs zum 30. September 2016 wurden die folgenden Anteilsklassen aufgelegt:

Anteilsklasse	Portfolio	Auflegungsdatum
DU	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	25. Juli 2016
ZGH	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	8. Juli 2016
AEH	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	5. August 2016
AU	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	5. August 2016
DEH	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	5. August 2016
DU	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	5. August 2016
IEC	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	5. August 2016
IEH	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	5. August 2016
IFH	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	5. August 2016
IU	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	5. August 2016
IUP	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	5. August 2016
ZEH	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	5. August 2016
ZU	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond	5. August 2016
AEP	Threadneedle (Lux) - Global Focus	8. Juli 2016
XU	Threadneedle (Lux) - Global Focus	8. Juli 2016
ZE	Threadneedle (Lux) - Global Focus	8. Juli 2016
ZEP	Threadneedle (Lux) - Global Focus	8. Juli 2016
ZG	Threadneedle (Lux) - Global Focus	8. Juli 2016
ZUP	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	27. Mai 2016
AEC	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	20. Juli 2016
AEH	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	20. Juli 2016
DEH	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	20. Juli 2016
IEH	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	20. Juli 2016
IGH	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	20. Juli 2016
ISH	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	20. Juli 2016
IU	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	20. Juli 2016
IVH	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	20. Juli 2016
ZEH	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	20. Juli 2016
ZFH	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	20. Juli 2016
ZU	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia	20. Juli 2016
AE	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	21. September 2016
AEP	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	21. September 2016

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

1 ALLGEMEINES

(Fortsetzung)

Anteilsklasse	Portfolio	Auflegungsdatum
AUH	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	21. September 2016
DE	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	21. September 2016
IE	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	21. September 2016
IGH	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	21. September 2016
LE	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	21. September 2016
XGH	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	21. September 2016
ZE	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	21. September 2016
ZGH	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	21. September 2016

Folgende Anteilklassen wurden während des Berichtszeitraums zum 30. September 2016 inaktiv:

Anteilsklasse	Portfolio	Auflegungsdatum
ZEC	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	5. August 2016
ZFH	Threadneedle (Lux) - American Select	22. April 2016

Zum 30. September 2016 lauteten die aktiven Portfolios der SICAV wie folgt:

Die Anleiheportfolios:

- Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond¹
- Threadneedle (Lux) - Global Corporate 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) - 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 Energy Equities¹
- Threadneedle (Lux) - Global Technology¹
- Threadneedle (Lux) - Mondrian Investment Partners - Focused Emerging Markets Equity
- Threadneedle (Lux) - UK Equities
- 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 Opportunities Bond
- Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

Das Specialist Portfolio:

- Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities¹

¹ Diese Portfolios wurden zum 30. September 2016 von der Securities and Futures Commission in Hongkong zugelassen und sind in Hongkong für die Öffentlichkeit verfügbar.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

2 ZUSAMMENFASSUNG DER WESENTLICHEN BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE

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.

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 andere Instrumente, die mit den Marktkonventionen in der Gerichtsbarkeit übereinstimmen, in der sie gehalten werden) mit einer Restlaufzeit von 90 Tagen oder weniger werden nach der Bewertungsmethode des fortgeführten Anschaffungswerts bewertet, der in etwa dem Marktwert entspricht. 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 Berichtszeitraums werden die offenen Devisenterminkontrakte zu den Terminkursen bewertet, die für die Restlaufzeit bis Fälligkeit gültig sind. Die Nettobewegung der entstandenen nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus Devisenterminkontrakten ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens ausgewiesen. Die zum 30. September 2016 ausstehenden Kontrakte sind in Anmerkung 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 30. September 2016 ausstehenden Kontrakte sind in Anmerkung 11 aufgeführt.

IV) Swap-Geschäfte

Die SICAV darf 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 30. September 2016 ausstehenden Kontrakte sind in Anmerkung 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 30. September 2016 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 30. September 2016 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 BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE

(Fortsetzung)

VI) Währungsumrechnung

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

Während des Berichtszeitraums 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 30. September 2016: 1 USD = 1,306762 AUD, 1 USD = 0,889838 EUR, 1 USD = 0,769823 GBP, 1 USD = 0,969400 CHF, 1 USD = 8,567365 SEK und 1 USD = 1,363449 SGD.

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

VII) Bankguthaben

Das in der Aufstellung des Nettovermögens angegebene Bankguthaben beinhaltet auch die Margen auf Futures.

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.

Zins, 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. Es liegt im Ermessen der Inhaber dieser Anteilklassen, sich die Dividende auszahlen zu lassen oder sie in die SICAV zu reinvestieren.

XI) Rückerstattungen der Vermögensverwaltungsgebühr

Eventuelle Vermögensverwaltungsgebühren, die in Bezug auf Anlagen in anderen Fonds von Columbia Threadneedle gezahlt wurden, werden an die Fonds zurückerstattet, damit sichergestellt ist, dass die Anleger nur die für sie geltenden Vermögensverwaltungsgebühren tragen.

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.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

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

Auch für Portfolios, deren einziges Ziel in der gemeinsamen Anlage in Geldmarktinstrumenten und der Platzierung von Einlagen bei Kreditinstituten besteht, gilt eine verringerte Steuer von 0,01 %. Diese Steuer fällt ebenfalls nicht auf den Anteil 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 setzen sich hauptsächlich aus Devisengebühren zusammen.

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.

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 auf dieser Seite 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 A-, I- und Z-Anteile des Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond Portfolio und bezüglich aller A-, D- und I-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 143 aufgeführten Sätzen festgelegt, mit Ausnahme der Anteilklasse M, für die die Betriebskosten 0,20 % pro Jahr betragen, und der Anteilklasse BU, für die die Betriebskosten 0,35 % pro Jahr betragen. Alle Aufwendungen fallen auf der Grundlage des Nettoinventarwertes der entsprechenden Anteilklasse im entsprechenden Portfolio täglich an.

Die Betriebskosten beinhalten unter anderem Steuern, Aufwendungen für Rechtsberatungs- und Prüfungsdienste, Druckkosten für Vollmachtsformulare, Aktienzertifikate, Berichte und Mitteilungen an die Anteilinhaber, Verkaufsprospekte und Dokumente mit den wesentlichen Informationen für den Anleger (KIID) sowie weitere Werbekosten, Gebühren und Kosten der Depotbank und deren Korrespondenten, der Domizilstelle, Verwaltungsstelle, Register und Transferstelle sowie der Zahlstelle, Aufwendungen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen, Registrierungsgebühren und Aufwendungen in verschiedenen Rechtsgebieten, Notierungsgebühren, Gebühren für nicht verbundene Verwaltungsratsmitglieder der SICAV, Aufwendungen für die Verwaltungsratsmitglieder und Führungskräfte der SICAV und die Unterberater für deren Teilnahme an Sitzungen des Verwaltungsrates und Versammlungen der Anteilinhaber der SICAV, Übersetzungskosten, Rechnungslegungs- und Kursermittlungskosten (einschließlich der Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil), Versicherung, Rechtsstreitigkeiten und sonstige außerordentliche oder nicht wiederkehrende Aufwendungen und alle sonstigen Aufwendungen, die durch die SICAV ordnungsgemäß zu entrichten sind. Die Betriebskosten beinhalten ferner die an die Verwaltungsgesellschaft zu entrichtende Servicegebühr. Die Depotbank und Unterdepotkosten werden nur bei der Anteilklasse M durch die entsprechenden Anteilklassen bei Entstehen entrichtet und sind nicht in den Betriebskosten enthalten. Die Verwaltungsgesellschaft trägt jegliche überschüssige 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.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Darüber hinaus hat die Verwaltungsgesellschaft Anspruch auf eine Vermögensverwaltungsgebühr (die „Vermögensverwaltungsgebühr“), die in den Tabellen ab Seite 143 näher beschrieben wird und die täglich anfällt und monatlich zahlbar ist. Für X-Anteile fällt keine Vermögensverwaltungsgebühr an. Um Zweifel auszuschließen, beinhalten die Betriebskosten weder Vermögensverwaltungsgebühren noch Erfolgsgebühren, welche getrennt sind und verschieden ausgewiesen werden.

Für die Anteilklasse M können Transaktionskosten (für Zeichnungen, Rücknahmen oder Umschichtungen) von bis zu 0,75 % des Nettoinventarwerts anfallen, wobei eine faire und angemessene Behandlung der Anteilinhaber sichergestellt sein muss. Für die Anteilklasse M läuft täglich eine Vermögensverwaltungsgebühr von bis zu 0,95 % des gesamten Nettoinventarwertes der Anteilklasse 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 Nettoinventarwerts der Klasse pro Jahr erhoben. B-Anteile des Global Technology Portfolio können nur von bestehenden Anteilhabern gezeichnet werden. Es wird eine bedingte gestaffelte Rücknahmegebühr („CDSC“) erhoben, wie auf Seite 148 beschrieben.

*Siehe Erläuterung 1.

A-ANTEILE:

Portfolio (s)	Ausgabeaufschlag als Prozentsatz des angelegten Betrags	Umtauschgebühr
Rentenportfolios	Maximal 2,0 %	Maximal 0,75 %
Aktienportfolio und Vermögensallokation-Portfolio	Maximal 5,0 %	Maximal 0,75 %
Absolute-Return-Portfolios	Maximal 5,0 %	Maximal 0,75 %
Specialist Portfolio	Maximal 5,0 %	Maximal 0,75 %

Ausgabeaufschläge sind Höchstwerte, auf die Vertriebsgesellschaften oder Untervertriebsgesellschaften je nach Zeichnungsumfang oder aufgrund von lokalen Markterwägungen ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Vermögensverwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Rentenportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	0,90 % ¹	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,90 %	0,25 % ²	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,90 % ¹	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,35 % ³	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,35 % ³	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,30 % ⁴	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
Vermögensallokations-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	1,35 % ³	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	1,25 %	0,30 %	USD
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	1,50 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	1,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus	1,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	1,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	1,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	1,50 %	0,35 %	EUR

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Vermögens-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Aktienportfolios				
<i>(Fortsetzung)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,50 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,50 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Greater China Equities	1,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Energy Equities	1,65 % ⁵	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	1,65 % ⁵	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	1,50 %	0,35 %	GBP
Absolute-Return-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	1,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia*	1,25 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	1,00 % ⁶	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha*	1,50 %	0,35 %	EUR
Specialist Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	1,75 %	0,35 %	USD

B-ANTEILE:

Portfolios	Ausgabeaufschlag als Prozentsatz des angelegten Betrags	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	Null	Maximal 0,75 %
	Bedingte gestaffelte Rücknahmegebühr	
	Einzelheiten zu der bei Rückgabe von B-Anteilen zu zahlenden bedingten gestaffelten Rücknahmegebühr sind in Abschnitt „B-Anteile – CDSC“ auf Seite 148 zu finden.	

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Vermögens-verwaltungsgebühr	Vertriebsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Aktienportfolio					
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	2,00 %	Null	0,35 %	USD

D-ANTEILE:

Portfolios	Ausgabeaufschlag als Prozentsatz des angelegten Betrags	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	Maximal 1,00 %	Maximal 0,75 %

Ausgabeaufschläge sind Höchstwerte, auf die Vertriebsgesellschaften oder Untervertriebsgesellschaften je nach Zeichnungsumfang oder aufgrund von lokalen Markterwägungen ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Vermögens-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Rentenportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	1,35 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	1,45 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	1,35 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,55 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond*	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond*	1,25 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	1,75 %	0,30 %	USD

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Vermögens-verwaltungsgebühr	Betriebs-kosten	Basis-währung
Vermögensallokations-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	2,25 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	2,00 %	0,30 %	USD
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	2,25 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	2,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	2,00 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	2,00 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	2,25 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	2,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus	2,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	2,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	2,00 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	2,25 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	2,40 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	2,50 %	0,35 %	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 %	0,35 %	USD
Absolute-Return-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	2,00 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia*	2,00 %	0,25 %	USD
	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 %	0,35 %	USD

W-ANTEILE (EINSCHLIESSLICH P- ANTEILE):

Portfolios	Ausgabeaufschlag als Prozentsatz des angelegten Betrags	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	Maximal 5,0 %	Maximal 0,75 %

Ausgabeaufschläge sind Höchstwerte, auf die Vertriebsgesellschaften oder Untervertriebsgesellschaften je nach Zeichnungsumfang oder aufgrund von lokalen Markterwägungen ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Vermögens-verwaltungsgebühr	Betriebs-kosten	Basis-währung
Rentenportfolios				
	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
Vermögensallokations-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	1,40 %	0,35 %	USD
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,40 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,65 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,15 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,40 %	0,35 %	USD

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Vermögens-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Aktienportfolios				
(Fortsetzung)				
	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
	Threadneedle (Lux) - Global Equities - Walter Scott & Partners*	1,00 %	0,20 %	EUR

S-ANTEILE:

Portfolio	Ausgabeaufschlag als Prozentsatz des angelegten Betrags	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	Maximal 5,0 %	Maximal 0,75 %

Ausgabeaufschläge sind Höchstwerte, auf die Vertriebsgesellschaften oder Untervertriebsgesellschaften je nach Zeichnungsumfang oder aufgrund von lokalen Markterwägungen ganz oder teilweise verzichten können.

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

I-ANTEILE:

Portfolio	Ausgabeaufschlag als Prozentsatz des angelegten Betrags	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k.A.	Maximal 0,75 %

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Vermögens-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Rentenportfolios				
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,40 % ⁷	0,15 % ⁸	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,50 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,80 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,80 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,80 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond*	0,55 % ⁹	0,10 % ⁸	USD
	Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond*	0,40 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,80 %	0,20 %	USD
Vermögensallokations-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	0,75 %	0,20 % ¹⁰	USD
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,85 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75 %	0,20 % ¹⁰	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,70 % ¹¹	0,20 % ¹⁰	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,80 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,85 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus	0,85 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	0,85 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,80 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,80 %	0,20 % ¹⁰	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,85 %	0,25 %	EUR

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Vermögens-verwaltungsgebühr	Betriebs-kosten	Basis-währung
Aktienportfolios				
(Fortsetzung)				
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,20 % ¹⁰	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,65 % ¹¹	0,20 % ¹⁰	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	1,25 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Global Emerging Markets Property Securities	1,25 %	0,35 %	USD
Absolute-Return-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75 %	0,20 % ¹⁰	USD
	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia*	0,65 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	0,55 % ⁹	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha*	0,75 %	0,20 %	USD
Specialist Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	1,00 %	0,25 %	USD

X-ANTEILE:

Portfolio	Ausgabeaufschlag als Prozentsatz des angelegten Betrags	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k.A.	Maximal 0,75 %

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Betriebs-kosten	Basis-währung
Aktienportfolios			
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,15 %	EUR
Absolute-Return-Portfolio			
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha*	0,15 %	EUR
Specialist Portfolio			
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,15 %	USD

Z-ANTEILE:

Portfolio	Ausgabeaufschlag als Prozentsatz des angelegten Betrags	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	5,00 %	Maximal 0,75 %

Ausgabeaufschläge sind Höchstwerte, auf die Vertriebsgesellschaften oder Untervertriebsgesellschaften je nach Zeichnungsumfang oder aufgrund von lokalen Markterwägungen ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Vermögens-verwaltungsgebühr	Betriebs-kosten	Basis-währung
Rentenportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,50 % ¹²	0,25 % ²	USD
	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
Vermögensallokations-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	0,75 %	0,30 %	USD

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Vermögens-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Aktienportfolios				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asian Focus	0,75 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	0,75 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,75 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	0,75 %	0,30 % ¹³	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,30 % ¹³	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75 %	0,35 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	1,25 %	0,35 %	USD
Absolute-Return-Portfolios				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75 %	0,30 % ¹³	USD
	Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia*	0,75 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	0,55 % ¹²	0,25 % ²	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha*	0,75 %	0,30 %	EUR
Specialist Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,75 %	0,35 %	USD

L-ANTEILE:

Portfolio	Ausgabeaufschlag als Prozentsatz des angelegten Betrags	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k.A.	Maximal 0,75 %

Ausgabeaufschläge sind Höchstwerte, auf die Vertriebsgesellschaften oder Untervertriebsgesellschaften je nach Zeichnungsumfang oder aufgrund von lokalen Markterwägungen ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-Typ	Name des Portfolios	Vermögens-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
Absolute-Return-Portfolio				
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha*	0,375 %	0,20 %	EUR

*Siehe Erläuterung 1.

¹1,00 % bis zum 30. Juni 2016.

²0,30 % bis zum 30. Juni 2016.

³1,50 % bis zum 30. Juni 2016.

⁴1,40 % bis zum 30. Juni 2016.

⁵1,75 % bis zum 30. Juni 2016.

⁶1,10 % bis zum 30. Juni 2016.

⁷0,50 % bis zum 30. Juni 2016.

⁸0,20 % bis zum 30. Juni 2016.

⁹0,65 % bis zum 30. Juni 2016.

¹⁰0,25 % bis zum 30. Juni 2016.

¹¹0,80 % bis zum 30. Juni 2016.

¹²0,60 % bis zum 30. Juni 2016.

¹³0,35 % bis zum 30. Juni 2016.

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 %
Über 1, aber weniger als 2 Jahre	1 %

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

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.

Am ersten Geschäftstag nach Ablauf der zweijährigen Frist ab dem Kauf werden B-Anteile automatisch in A-Anteile desselben Portfolios umgetauscht und unterliegen daraufhin der Gebührenstruktur der A-Anteile. Insbesondere die bedingte gestaffelte Rücknahmegebühr und die Vertriebsgebühr werden dann nicht mehr erhoben.

6 PROVISIONSTEILUNGSVEREINBARUNGEN

Die Verwaltungsgesellschaft und der jeweilige 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. Für die bestmögliche Ausführung können Maklerprovisionen für Portfoliotransaktionen der SICAV von der Verwaltungsgesellschaft oder dem Unterberater an Makler-Händler insbesondere für von diesen erbrachte Research-Dienstleistungen gewährt werden, sowie für Dienstleistungen, die im Rahmen der Ausführung von Aufträgen solcher Broker-Dealer erbracht wurden.

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 Unterberaters; (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) das erhaltene Research besitzt einen nachweisbaren Nutzen für die Anteilinhaber der SICAV und kann einen Mehrwert für den Entscheidungsfindungsprozess und die Abwicklungsdienste eines Unterberaters liefern.

7 DIVIDENDEN

Die SICAV hat während des Berichtszeitraums zum 30. September 2016 die folgenden Dividenden erklärt:

Portfolio	Anteilsklasse	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	Klasse DEC	25.04.2016	USD	0,046	861
	Klasse DEC	24.05.2016	USD	0,046	1.345
	Klasse DEC	24.06.2016	USD	0,026	926
	Klasse DEC	25.07.2016	USD	0,025	872
	Klasse DEC	24.08.2016	USD	0,026	1.179
	Klasse DEC	26.09.2016	USD	0,026	1.168
					USD 6.351
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Klasse AEP	25.04.2016	EUR	0,020	7.780
	Klasse AEP	24.05.2016	EUR	0,020	7.829
	Klasse AEP	24.06.2016	EUR	0,023	9.132
	Klasse AEP	25.07.2016	EUR	0,023	9.554

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilsklasse	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond (Fortsetzung)	Klasse AEP	24.08.2016	EUR	0,023	9.693
	Klasse AEP	26.09.2016	EUR	0,023	9.736
	Klasse DEP	25.04.2016	EUR	0,015	3.304
	Klasse DEP	24.05.2016	EUR	0,015	3.208
	Klasse DEP	24.06.2016	EUR	0,017	3.495
	Klasse DEP	25.07.2016	EUR	0,017	3.453
	Klasse DEP	24.08.2016	EUR	0,017	3.758
	Klasse DEP	26.09.2016	EUR	0,017	3.927
					EUR 74.869
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	Klasse AEC	25.04.2016	USD	0,074	37.444
	Klasse AEC	24.05.2016	USD	0,074	38.434
	Klasse AEC	24.06.2016	USD	0,074	38.581
	Klasse AEC	25.07.2016	USD	0,072	36.930
	Klasse AEC	24.08.2016	USD	0,075	37.611
	Klasse AEC	26.09.2016	USD	0,074	36.234
	Klasse AUP	25.04.2016	USD	0,038	40.194
	Klasse AUP	24.05.2016	USD	0,038	40.002
	Klasse AUP	24.06.2016	USD	0,038	39.328
	Klasse AUP	25.07.2016	USD	0,038	38.845
	Klasse AUP	24.08.2016	USD	0,038	38.972
	Klasse AUP	26.09.2016	USD	0,038	38.587
	Klasse DEC	25.04.2016	USD	0,055	792
	Klasse DEC	24.05.2016	USD	0,055	720
	Klasse DEC	24.06.2016	USD	0,055	619
	Klasse DEC	25.07.2016	USD	0,054	752
	Klasse DEC	24.08.2016	USD	0,055	851
	Klasse DEC	26.09.2016	USD	0,055	844
	Klasse P	25.04.2016	USD	0,044	255
	Klasse P	24.05.2016	USD	0,044	255
	Klasse P	24.06.2016	USD	0,044	255
	Klasse P	25.07.2016	USD	0,044	255
	Klasse P	24.08.2016	USD	0,044	255
	Klasse P	26.09.2016	USD	0,044	255
					USD 467.270
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	Klasse AEC	25.04.2016	USD	0,056	4.726
	Klasse AEC	24.05.2016	USD	0,056	4.755
	Klasse AEC	24.06.2016	USD	0,061	5.156
	Klasse AEC	25.07.2016	USD	0,059	5.033
	Klasse AEC	24.08.2016	USD	0,061	5.255
	Klasse AEC	26.09.2016	USD	0,061	5.334
	Klasse AUP	25.04.2016	USD	0,055	372.313
	Klasse AUP	24.05.2016	USD	0,055	370.119
	Klasse AUP	24.06.2016	USD	0,060	399.625
	Klasse AUP	25.07.2016	USD	0,060	395.687
	Klasse AUP	24.08.2016	USD	0,060	390.327
	Klasse AUP	26.09.2016	USD	0,060	387.560
	Klasse SUP	25.04.2016	USD	0,054	9.924

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilsklasse	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt (Fortsetzung)	Klasse SUP	24.05.2016	USD	0,054	9.924
	Klasse SUP	24.06.2016	USD	0,058	10.476
	Klasse SUP	25.07.2016	USD	0,058	10.375
	Klasse SUP	24.08.2016	USD	0,058	10.375
	Klasse SUP	26.09.2016	USD	0,058	10.305
					USD 2.407.269
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	Klasse AEC	25.04.2016	USD	0,035	27.365
	Klasse AEC	24.05.2016	USD	0,035	27.264
	Klasse AEC	24.06.2016	USD	0,037	29.544
	Klasse AEC	25.07.2016	USD	0,036	27.674
	Klasse AEC	24.08.2016	USD	0,037	29.299
	Klasse AEC	26.09.2016	USD	0,037	31.333
	Klasse ASC	25.04.2016	USD	0,029	1.360
	Klasse ASC	24.05.2016	USD	0,028	1.336
	Klasse ASC	24.06.2016	USD	0,031	1.484
	Klasse ASC	25.07.2016	USD	0,031	1.611
	Klasse ASC	24.08.2016	USD	0,031	1.843
	Klasse ASC	26.09.2016	USD	0,031	1.549
	Klasse AUP	25.04.2016	USD	0,030	112.407
	Klasse AUP	24.05.2016	USD	0,030	112.081
	Klasse AUP	24.06.2016	USD	0,032	117.459
	Klasse AUP	25.07.2016	USD	0,032	116.662
	Klasse AUP	24.08.2016	USD	0,032	116.173
	Klasse AUP	26.09.2016	USD	0,032	115.161
					USD 871.605
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond*	Klasse AEC	25.04.2016	USD	0,072	4.794
	Klasse AEC	24.05.2016	USD	0,072	5.381
	Klasse AEC	24.06.2016	USD	0,072	5.415
	Klasse AEC	25.07.2016	USD	0,070	5.965
	Klasse AEC	24.08.2016	USD	0,072	6.333
	Klasse AEC	26.09.2016	USD	0,660	7.687
	Klasse AUP	25.04.2016	USD	0,061	75.612
	Klasse AUP	24.05.2016	USD	0,061	83.462
	Klasse AUP	24.06.2016	USD	0,061	43.638
	Klasse AUP	25.07.2016	USD	0,061	31.237
	Klasse AUP	24.08.2016	USD	0,061	42.864
	Klasse AUP	26.09.2016	USD	0,057	47.239
	Klasse DEC	25.04.2016	USD	0,055	3.696
	Klasse DEC	24.05.2016	USD	0,055	3.603
	Klasse DEC	24.06.2016	USD	0,055	3.630
	Klasse DEC	25.07.2016	USD	0,054	3.532
	Klasse DEC	24.08.2016	USD	0,055	4.029
	Klasse DEC	26.09.2016	USD	0,052	3.772
					USD 381.889

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilstklasse	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	Klasse AEC	25.04.2016	USD	0,021	2.338
	Klasse AEC	24.05.2016	USD	0,021	2.330
	Klasse AEC	24.06.2016	USD	0,025	2.772
	Klasse AEC	25.07.2016	USD	0,024	2.698
	Klasse AEC	24.08.2016	USD	0,025	2.721
	Klasse AEC	26.09.2016	USD	0,025	2.697
	Klasse AUP	25.04.2016	USD	0,020	19.777
	Klasse AUP	24.05.2016	USD	0,020	19.671
	Klasse AUP	24.06.2016	USD	0,023	21.915
	Klasse AUP	25.07.2016	USD	0,023	21.618
	Klasse AUP	24.08.2016	USD	0,023	21.424
	Klasse AUP	26.09.2016	USD	0,023	21.339
	USD 141.300				
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Klasse AEC	24.06.2016	USD	0,176	257.898
	Klasse AEC	26.09.2016	USD	0,175	309.739
	Klasse AEP	24.06.2016	USD	0,171	6.055
	Klasse AEP	26.09.2016	USD	0,171	7.911
	Klasse AUP	24.06.2016	USD	0,151	27.415
	Klasse AUP	26.09.2016	USD	0,151	36.804
	Klasse DEC	24.06.2016	USD	0,175	312.103
	Klasse DEC	26.09.2016	USD	0,174	333.002
	Klasse DEP	24.06.2016	USD	0,175	3.015
	Klasse DEP	26.09.2016	USD	0,174	11.876
	Klasse DUP	24.06.2016	USD	0,156	136.311
	Klasse DUP	26.09.2016	USD	0,156	116.974
	Klasse ZEC	24.06.2016	USD	0,174	28.598
	USD 1.587.701				
Threadneedle (Lux) - Global Focus	Klasse AEP	26.09.2016	USD	0,017	54
	Klasse ZEP	26.09.2016	USD	0,014	41.836
					USD 41.890
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	Klasse ASC	25.04.2016	USD	0,022	53.890
	Klasse ASC	24.05.2016	USD	0,022	55.044
	Klasse ASC	24.06.2016	USD	0,022	56.431
	Klasse ASC	25.07.2016	USD	0,022	50.101
	Klasse ASC	24.08.2016	USD	0,022	50.646
	Klasse ASC	26.09.2016	USD	0,022	48.292
	Klasse AUP	25.04.2016	USD	0,030	5.078
	Klasse AUP	24.05.2016	USD	0,030	5.090
	Klasse AUP	24.06.2016	USD	0,030	5.089
	Klasse AUP	25.07.2016	USD	0,030	5.091
	Klasse AUP	24.08.2016	USD	0,030	5.369
	Klasse AUP	26.09.2016	USD	0,030	4.844
	Klasse AVC	25.04.2016	USD	0,023	3.632
	Klasse AVC	24.05.2016	USD	0,022	3.075
	Klasse AVC	24.06.2016	USD	0,022	3.200
	Klasse AVC	25.07.2016	USD	0,022	3.407

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilsklasse	Ex-Datum	Währung	Betrag je Anteil	Gesamtbetrag
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income (Fortsetzung)	Klasse AVC	24.08.2016	USD	0,023	3.560
	Klasse AVC	26.09.2016	USD	0,023	3.095
					USD 364.934
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	Klasse AEC	26.09.2016	USD	0,028	15
	Klasse AUP	26.09.2016	USD	0,106	52.202
					USD 52.217
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	Klasse ZUP	26.09.2016	USD	0,243	708
					USD 708
Threadneedle (Lux) - UK Equities	Klasse AGP	26.09.2016	GBP	0,443	181.875
	Klasse IGP	26.09.2016	GBP	0,518	528.642
	Klasse ZGP	26.09.2016	GBP	0,092	55.086
					GBP 765.603

*Siehe Erläuterung 1.

8 ERFOLGSGEBÜHREN

Die Verwaltungsgesellschaft hat, wie nachfolgend dargelegt, Anspruch auf eine Erfolgsgebühr im Hinblick auf die Anteilsklassen der Portfolios, die in nachstehender Tabelle aufgeführt sind. 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. Der Betrag dieser Erfolgsgebühr richtet sich nach der Entwicklung des Nettoinventarwerts der betreffenden Anteilsklasse innerhalb des entsprechenden Portfolios gemessen an der Wertentwicklung des betreffenden Performance-Index (der „Performance-Index“, siehe Tabelle unten mit Ausnahme des Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond Portfolios, siehe nachstehende Erläuterung). Rückstellungen werden nur gebildet, wenn der Saldo der Erfolgsgebühr positiv ist und die NIW High Water Mark (nachstehend definiert) überstiegen wird.

Die Performance der Anteilsklassen beinhaltet die ausgeschütteten Dividenden.

Portfolio	Anteilsklassen	Performance-Index	Performance-Rate
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	A-Anteile	3-Monats-LIBOR (USD)	20 % ¹
	D-Anteile		
	I-Anteile		
	Z-Anteile		
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	A-Anteile	1-Monats-USD-Einlagenrate +4,5 %	15 % ²
	I-Anteile		
	Z-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 Portfolios und des Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha Portfolios*, unter Berücksichtigung aller anwendbaren Gebühren, wird mit dem Performance-Index verglichen.

Die Performance des Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond Portfolios (vor Abzug von Gebühren) wird mit dem Performance-Index verglichen.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

8 ERFOLGSGEBÜHREN

(Fortsetzung)

Der Saldo der Erfolgsgebühr errechnet sich basierend auf der Differenz zwischen der Wertentwicklung des Performance Index und der Wertentwicklung der betreffenden Anteilklasse (der „Tagesunterschied“):

- (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 Erfolgsgebühr fließt der Verwaltungsgesellschaft nur dann zu, wenn der Nettoinventarwert der betreffenden Anteilklasse den Höchststand des Nettoinventarwerts (die High Water Mark) übersteigt.

Ist der Saldo der Erfolgsgebühr negativ, wird der negative Betrag auf die neue Rechnung vorgetragen und die Verwaltungsgesellschaft erhält so lange keine Erfolgsgebühr, bis die aufgelaufene Erfolgsgebühr an einem nachfolgenden Kalenderjahresende wieder positiv ausfällt.

Für den Fall, dass ein Portfolio oder eine Anteilklasse liquidiert wird oder ein Portfolio oder eine Anteilklasse inaktiv wird, ist eine ggf. aufgelaufene ausstehende Erfolgsgebühr zu realisieren und an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlen. Anschließend, wenn neue Anteilinhaber in ein solches Portfolio oder eine solche Klasse investiert haben, wird der Saldo neu festgelegt.

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. Ist bis dahin nie eine Erfolgsgebühr bezahlt worden, entspricht die NIW High Water Mark dem Auflegungspreis der entsprechenden Anteilklasse.

Zum 30. September 2016 belief sich die Erfolgsgebühr auf 1.672 EUR für Threadneedle (Lux) – Pan European Absolute Alpha*.

*Siehe Erläuterung 1.

¹Der Performance-Index ist mit Wirkung zum 1. Januar 2017 der höhere Wert aus dem 3-Monats-LIBOR (US-Dollar) oder null.

²Ab dem 1. Januar 2017 ist keine Erfolgsgebühr zahlbar.

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

Zum 30. September 2016 hielt die SICAV die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	21.10.2016	JPY	53.705.886	EUR	471.298	Handel	UBS AG Stamford Branch	627
	19.10.2016	USD	682	EUR	610	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	21.10.2016	USD	480.410	EUR	429.146	Handel	Citibank	(2.361)
	19.10.2016	USD	4.105	EUR	3.666	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	21.10.2016	USD	2.822.152	NZD	3.867.122	Handel	Royal Bank Of Scotland	12.498
	21.10.2016	USD	823.554	HUF	226.925.395	Handel	Royal Bank Of Scotland	(1.569)
	21.10.2016	USD	2.021.541	GBP	1.548.158	Handel	Royal Bank Of Scotland	9.535
	21.10.2016	USD	823.480	CAD	1.082.739	Handel	HSBC	(514)
	21.10.2016	SEK	9.641.918	USD	1.127.715	Handel	UBS AG Stamford Branch	(1.067)
	21.10.2016	MXN	1.539.536	USD	78.108	Handel	JP Morgan	1.242
	21.10.2016	MXN	13.575.493	USD	692.143	Handel	Citibank	7.565
	21.10.2016	JPY	241.039.736	USD	2.370.576	Handel	UBS AG Stamford Branch	11.819
	21.10.2016	EUR	4.803.922	USD	5.371.837	Handel	UBS AG Stamford Branch	32.389
	21.10.2016	CHF	132.960	USD	135.859	Handel	Goldman Sachs	1.471
	21.10.2016	AUD	321.646	USD	242.399	Handel	Citibank	3.619
	21.10.2016	USD	1.549.761	RUB	101.657.321	Handel	Citibank	(56.174)
	21.10.2016	USD	498.455	IDR	6.582.353.974	Handel	UBS AG Stamford Branch	(6.275)
	21.10.2016	KRW	370.534.195	USD	329.806	Handel	UBS AG Stamford Branch	6.394
	19.10.2016	EUR	420.368	USD	472.349	Absicherung	JP Morgan Chase New York	501
	19.10.2016	EUR	172.132	USD	193.417	Absicherung	JP Morgan Chase New York	205
	19.10.2016	EUR	1.658.721	USD	1.863.832	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.977

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(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)	06.12.2016	USD	1.859.511	CNY	12.507.074	Handel	HSBC	(6.297)
	25.11.2016	CNY	6.311.884	USD	942.846	Handel	HSBC	(678)
	25.11.2016	USD	64.285	CNY	429.421	Handel	HSBC	186
	21.10.2016	USD	284.258	EUR	254.644	Handel	Citibank	(2.204)
	21.10.2016	USD	306.922	RUB	19.916.193	Handel	UBS AG Stamford Branch	(7.689)
	21.10.2016	GBP	808.950	EUR	941.556	Handel	UBS AG Stamford Branch	(7.886)
	21.10.2016	NOK	8.606.751	EUR	942.168	Handel	Barclays Capital	17.034
	21.10.2016	GBP	856.483	USD	1.115.795	Handel	Goldman Sachs	(2.701)
	21.10.2016	EUR	945.162	NOK	8.557.500	Handel	Citibank	(7.520)
	21.10.2016	EUR	964.066	SEK	9.288.042	Handel	UBS AG Stamford Branch	(761)
	21.10.2016	GBP	815.824	EUR	945.104	Handel	UBS AG Stamford Branch	(2.949)
	21.10.2016	USD	424.233	MXN	8.342.975	Handel	Citibank	(5.795)
	25.11.2016	USD	2.182.537	CNY	14.498.595	Handel	HSBC	18.419
								USD 13.018
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond								
	19.10.2016	GBP	1.672	USD	2.209	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(36)
	19.10.2016	SEK	17.916	USD	2.108	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
	19.10.2016	GBP	18.380.079	USD	24.284.810	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(398.902)
	19.10.2016	EUR	1.979	USD	2.224	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2016	EUR	1.936	USD	2.175	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2016	SEK	17.671	USD	2.079	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
	19.10.2016	EUR	1.951	USD	2.192	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2016	EUR	1.951	USD	2.192	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	05.12.2016	CHF	1.200	USD	1.240	Handel	Goldman Sachs	3
	05.12.2016	USD	4.045.833	GBP	3.018.000	Handel	Goldman Sachs	120.021
	05.12.2016	USD	42.889	GBP	32.000	Handel	Goldman Sachs	1.264
	05.12.2016	USD	6.321.605	EUR	5.600.000	Handel	Goldman Sachs	8.330
	05.12.2016	USD	105.546	CHF	101.700	Handel	Goldman Sachs	214
	05.12.2016	USD	321.325	CAD	412.600	Handel	Barclays Capital	7.220
	05.12.2016	USD	3.268	CAD	4.300	Handel	Goldman Sachs	(5)
	06.10.2016	EUR	100.000	USD	111.762	Handel	Barclays Capital	649
	05.12.2016	USD	65.046	GBP	50.000	Handel	Barclays Capital	8
	05.12.2016	USD	134.985	EUR	120.000	Handel	Barclays Capital	(298)
	05.10.2016	EUR	90.000	USD	100.983	Handel	Barclays Capital	181
	19.10.2016	GBP	34.107	USD	44.310	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	05.12.2016	USD	48.018	GBP	37.000	Handel	Goldman Sachs	(110)
	05.12.2016	USD	105.537	GBP	80.000	Handel	Goldman Sachs	1.475
	05.12.2016	USD	112.055	EUR	100.000	Handel	Barclays Capital	(680)
	05.12.2016	GBP	33.000	USD	43.662	Handel	Barclays Capital	(737)
	05.12.2016	EUR	55.000	USD	61.957	Handel	Goldman Sachs	48
								USD (261.363)
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond								
	21.10.2016	EUR	3.361.531	SEK	32.355.290	Handel	UBS AG Stamford Branch	807
	21.10.2016	GBP	2.954.676	EUR	3.430.068	Handel	Goldman Sachs	(16.682)
	21.10.2016	EUR	235.832	USD	264.004	Handel	Royal Bank of Canada	1.155
	21.10.2016	SEK	32.225.321	EUR	3.368.497	Handel	Citibank	(21.273)

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) - European Strategic Bond								
(Fortsetzung)	21.10.2016	EUR	5.345.515	USD	5.977.050	Handel	Royal Bank of Canada	32.431
	21.10.2016	EUR	2.869.380	HUF	884.222.796	Handel	Royal Bank Of Scotland	11.406
	21.10.2016	EUR	14.360.266	GBP	12.292.057	Handel	Royal Bank of Canada	159.969
	21.10.2016	EUR	1.357.288	DKK	10.112.650	Handel	Citibank	(802)
	21.10.2016	EUR	136.128	CHF	148.988	Handel	Royal Bank of Canada	(664)
	21.10.2016	USD	5.750.538	RUB	377.209.445	Handel	Citibank	(185.480)
								EUR (19.133)
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds								
	19.10.2016	SGD	74.985	USD	54.872	Absicherung	JP Morgan Chase New York	132
	19.10.2016	EUR	6.563.136	USD	7.374.708	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7.823
	19.10.2016	EUR	4.127.156	USD	4.637.503	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.920
	19.10.2016	EUR	9.710.209	USD	10.910.935	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11.576
	19.10.2016	USD	5.198	EUR	4.626	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	19.10.2016	EUR	85	USD	95	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	USD	8.484	EUR	7.521	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23
	19.10.2016	USD	27.218	EUR	24.130	Absicherung	JP Morgan Chase New York	75
	19.10.2016	USD	128.239	EUR	114.181	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(196)
	19.10.2016	EUR	20.456	USD	22.975	Absicherung	JP Morgan Chase New York	35
	19.10.2016	USD	12.078	EUR	10.754	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	19.10.2016	USD	29.334	EUR	26.068	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	19.10.2016	EUR	990	USD	1.114	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	EUR	85	USD	95	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	EUR	990	USD	1.104	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.10.2016	USD	681	EUR	610	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.10.2016	USD	15.539	EUR	13.893	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(89)
	19.10.2016	USD	143.857	EUR	128.622	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(822)
	19.10.2016	EUR	568	USD	636	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2016	EUR	990	USD	1.109	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2016	USD	11.866	EUR	10.597	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(54)
	19.10.2016	USD	53.551	EUR	47.910	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(341)
	19.10.2016	EUR	120	USD	135	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	USD	2.206	EUR	1.959	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2016	USD	6.049	EUR	5.371	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	19.10.2016	USD	1.271	EUR	1.129	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2016	EUR	166.421	USD	187.000	Absicherung	JP Morgan Chase New York	198
	19.10.2016	EUR	335.370	USD	376.841	Absicherung	JP Morgan Chase New York	400
	19.10.2016	EUR	7.386.169	USD	8.299.514	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8.804
								USD 32.495
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt								
	19.10.2016	EUR	743.137	USD	835.031	Absicherung	JP Morgan Chase New York	886
	19.10.2016	EUR	190.202	USD	213.721	Absicherung	JP Morgan Chase New York	227
	19.10.2016	EUR	5.661.422	USD	6.361.491	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.748
	19.10.2016	EUR	1.027.960	USD	1.155.073	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.225

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(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 Debt								
(Fortsetzung)	19.10.2016	SGD	82.681	USD	60.505	Absicherung	JP Morgan Chase New York	146
	19.10.2016	EUR	2.485	USD	2.798	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2016	USD	5.507.575	EUR	4.889.998	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7.064
	19.10.2016	USD	44.628	EUR	39.711	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
	19.10.2016	USD	23.622	EUR	21.134	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(150)
	19.10.2016	EUR	4.963	USD	5.547	Absicherung	JP Morgan Chase New York	35
	19.10.2016	EUR	1.000	USD	1.118	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.10.2016	EUR	9.985	USD	11.136	Absicherung	JP Morgan Chase New York	96
	19.10.2016	EUR	9.985	USD	11.214	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17
	19.10.2016	EUR	872.035	USD	983.631	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.724)
	19.10.2016	EUR	4.354	USD	4.876	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	19.10.2016	SGD	9.119	USD	6.696	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	10.11.2016	USD	1.263.846	COP	3.788.377.615	Handel	Barclays Capital	(39.699)
	10.11.2016	USD	528.342	MXN	9.897.095	Handel	JP Morgan	19.507
								USD (6.645)
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds								
	19.10.2016	EUR	14.340.082	USD	16.113.319	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17.093
	19.10.2016	EUR	4.972.083	USD	5.586.910	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.927
	19.10.2016	EUR	5.856.140	USD	6.580.287	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.981
	10.11.2016	USD	1.466.287	MXN	27.984.063	Handel	Citibank	27.422
	19.10.2016	SGD	137	USD	100	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	SGD	19.600	USD	14.386	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.10.2016	EUR	100.213	USD	112.611	Absicherung	JP Morgan Chase New York	113
	19.10.2016	EUR	2.967.966	USD	3.335.160	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.351
	19.10.2016	EUR	4.936	USD	5.546	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.10.2016	USD	17.170	EUR	15.279	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
	19.10.2016	SGD	46.711	USD	34.300	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(35)
	19.10.2016	EUR	98	USD	110	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2016	USD	116.881	EUR	104.283	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(421)
	19.10.2016	EUR	4.067	USD	4.559	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16
	19.10.2016	SGD	819	USD	602	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2016	SGD	20.993	USD	15.444	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(45)
	19.10.2016	EUR	4.970	USD	5.606	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16)
	19.10.2016	EUR	15.475	USD	17.456	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(48)
	19.10.2016	EUR	4.965	USD	5.601	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16)
	19.10.2016	SGD	9.791	USD	7.204	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.10.2016	EUR	1.462.280	USD	1.642.324	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.518
	19.10.2016	EUR	88.358	USD	99.237	Absicherung	JP Morgan Chase New York	152
	19.10.2016	USD	389	SGD	526	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2016	SGD	7.426	USD	5.486	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(39)
	10.11.2016	MXN	27.984.063	USD	1.413.704	Handel	HSBC	25.292
	10.11.2016	BRL	6.698.282	USD	2.050.009	Handel	Barclays Capital	(13.309)
	19.10.2016	USD	19.776	EUR	17.693	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(126)
	19.10.2016	USD	201	EUR	180	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(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)	19.10.2016	SGD	10.000	USD	7.335	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2016	SGD	123.111	USD	90.297	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
	19.10.2016	EUR	30.586	USD	34.438	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(33)
	10.11.2016	USD	1.979.515	BRL	6.698.283	Handel	Citibank	(57.887)
	19.10.2016	EUR	3.293	USD	3.709	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	19.10.2016	EUR	2.009	USD	2.262	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2016	EUR	165.986	USD	186.512	Absicherung	JP Morgan Chase New York	198
	19.10.2016	SGD	416.477	USD	304.771	Absicherung	JP Morgan Chase New York	735
	19.10.2016	SGD	475.412	USD	347.899	Absicherung	JP Morgan Chase New York	839
	19.10.2016	EUR	5.717.282	USD	6.424.258	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.815
	19.10.2016	USD	46.738	EUR	41.815	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(297)
								USD 25.145
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond*								
	19.10.2016	EUR	29.299	USD	32.999	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
	19.10.2016	USD	589	SGD	803	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	USD	36.506	EUR	32.661	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(232)
	19.10.2016	EUR	30.000	USD	33.532	Absicherung	JP Morgan Chase New York	213
	19.10.2016	EUR	85	USD	95	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	SGD	2.500	USD	1.836	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2016	EUR	150	USD	168	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2016	USD	583	SGD	793	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2016	USD	21.652	EUR	19.241	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.10.2016	EUR	19.670	USD	22.135	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.10.2016	SGD	3.000	USD	2.207	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	19.10.2016	EUR	185	USD	208	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	EUR	8.174	USD	9.220	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(26)
	19.10.2016	SGD	5.000	USD	3.679	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.10.2016	EUR	67.781	USD	75.970	Absicherung	JP Morgan Chase New York	274
	19.10.2016	USD	2.472.182	EUR	2.200.000	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.481)
	19.10.2016	EUR	24.988	USD	28.079	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28
	19.10.2016	EUR	839.629	USD	943.454	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.001
	19.10.2016	EUR	1.066.668	USD	1.198.568	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.271
	19.10.2016	EUR	66.048.866	USD	74.216.205	Absicherung	JP Morgan Chase New York	78.730
	19.10.2016	SGD	496.557	USD	363.372	Absicherung	JP Morgan Chase New York	877
	19.10.2016	EUR	1.625.254	USD	1.826.226	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.937
	19.10.2016	EUR	802.866	USD	902.145	Absicherung	JP Morgan Chase New York	957
	19.10.2016	GBP	1.024	USD	1.353	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.10.2016	SGD	4.586	USD	3.360	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.10.2016	EUR	10.000	USD	11.263	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
								USD 82.458
Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond*								
	19.10.2016	EUR	4.502	USD	5.059	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2016	CHF	4.877	USD	4.998	Absicherung	JP Morgan Chase New York	39
	19.10.2016	EUR	4.503	USD	5.059	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(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 Investment Grade Corporate Bond*								
(Fortsetzung)	19.10.2016	EUR	4.503	USD	5.060	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2016	EUR	4.498	USD	5.055	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2016	EUR	4.500	USD	5.057	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
								USD 65
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond								
	19.10.2016	SGD	2.802	USD	2.051	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2016	EUR	2.774	USD	3.117	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2016	EUR	2.843	USD	3.195	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2016	GBP	20.058.263	USD	26.502.120	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(435.323)
	19.10.2016	SGD	2.907	USD	2.127	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2016	SGD	197.178	USD	144.479	Absicherung	JP Morgan Chase New York	161
	07.10.2016	KRW	1.300.000.000	USD	1.176.077	Handel	Citibank	3.595
	11.10.2016	USD	171.158	MYR	700.000	Handel	Citibank	1.788
	19.10.2016	EUR	2.807	USD	3.155	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2016	SGD	13.104	USD	9.604	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.10.2016	SGD	4.991	USD	3.661	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	SGD	2.777	USD	2.041	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.10.2016	EUR	74.225	USD	83.017	Absicherung	JP Morgan Chase New York	475
	19.10.2016	SGD	11.400	USD	8.373	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.10.2016	USD	6.284	SGD	8.543	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17
	11.10.2016	MYR	700.000	USD	170.524	Handel	Citibank	(1.155)
	28.11.2016	KRW	470.000.000	USD	423.843	Handel	Citibank	2.465
	19.10.2016	SGD	22.569	USD	16.604	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(49)
	19.10.2016	USD	51.522	SGD	70.140	Absicherung	JP Morgan Chase New York	70
	19.10.2016	USD	20.208	SGD	27.520	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21
	19.10.2016	SGD	6.277.079	USD	4.593.464	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11.081
								USD (416.840)
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation								
	19.10.2016	EUR	600	USD	677	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2016	EUR	990	USD	1.110	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.10.2016	USD	9.876	EUR	8.819	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
	19.10.2016	USD	3.023	EUR	2.690	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.10.2016	EUR	700	USD	787	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2016	EUR	14.675.054	USD	16.489.713	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17.493
	19.10.2016	EUR	4.616.470	USD	5.187.324	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.503
	19.10.2016	EUR	1.449.781	USD	1.629.055	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.728
	19.10.2016	GBP	613.220	USD	810.222	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13.309)
	19.10.2016	USD	2.070	EUR	1.839	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2016	USD	54.337	EUR	48.266	Absicherung	JP Morgan Chase New York	45
	19.10.2016	EUR	1.980	USD	2.230	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.10.2016	EUR	250	USD	281	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	USD	22.035	EUR	19.570	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21
	19.10.2016	USD	52.777	EUR	47.218	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(336)
	19.10.2016	EUR	1.559	USD	1.746	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	19.10.2016	GBP	21.600	USD	28.231	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(161)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(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 Asset Allocation								
(Fortsetzung)	19.10.2016	EUR	141.642	USD	158.419	Absicherung	JP Morgan Chase New York	906
	19.10.2016	USD	38.859	EUR	34.532	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16
	19.10.2016	EUR	202	USD	227	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	02.12.2016	USD	9.019.398	AUD	12.000.000	Handel	Royal Bank Of Scotland	(150.477)
	02.12.2016	USD	6.002.949	MXN	113.000.000	Handel	Barclays Capital	208.244
	02.12.2016	JPY	559.999.999	USD	5.478.058	Handel	UBS AG Stamford Branch	66.714
	02.12.2016	USD	4.367.959	EUR	3.900.000	Handel	Citibank	(27.952)
	02.12.2016	AUD	4.250.000	USD	3.182.559	Handel	JP Morgan	65.027
								USD 173.425
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income								
	19.10.2016	EUR	17.473	USD	19.530	Absicherung	JP Morgan Chase New York	124
	19.10.2016	EUR	19.990	USD	22.383	Absicherung	JP Morgan Chase New York	103
	19.10.2016	EUR	66.416	USD	74.367	Absicherung	JP Morgan Chase New York	341
	19.10.2016	EUR	124.717	USD	139.490	Absicherung	JP Morgan Chase New York	798
	19.10.2016	EUR	34.900	USD	39.034	Absicherung	JP Morgan Chase New York	223
	19.10.2016	EUR	218.268	USD	243.429	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.089
	19.10.2016	EUR	19.985	USD	22.289	Absicherung	JP Morgan Chase New York	191
	19.10.2016	EUR	67.489	USD	75.945	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(31)
	19.10.2016	EUR	11.111	USD	12.503	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	19.10.2016	EUR	99.588	USD	111.850	Absicherung	JP Morgan Chase New York	171
	19.10.2016	EUR	23.413	USD	26.296	Absicherung	JP Morgan Chase New York	40
	19.10.2016	EUR	175.003	USD	197.398	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(547)
	19.10.2016	EUR	55.975	USD	63.138	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(175)
	31.10.2016	USD	358.850	CHF	348.300	Handel	HSBC	(1.120)
	31.10.2016	USD	18.938.428	EUR	16.887.418	Handel	HSBC	(68.609)
	31.10.2016	USD	6.221.463	GBP	4.788.280	Handel	Citibank	(2.734)
	19.10.2016	EUR	328.410	USD	368.085	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.326
	19.10.2016	EUR	52.721	USD	59.090	Absicherung	JP Morgan Chase New York	213
	19.10.2016	EUR	31.368	USD	35.127	Absicherung	JP Morgan Chase New York	157
	19.10.2016	EUR	329.860	USD	369.388	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.655
	19.10.2016	EUR	48.145	USD	54.101	Absicherung	JP Morgan Chase New York	54
	19.10.2016	EUR	265.827	USD	298.715	Absicherung	JP Morgan Chase New York	300
	06.10.2016	GBP	100.000	USD	129.754	Handel	Royal Bank Of Scotland	164
	31.10.2016	USD	129.815	GBP	100.000	Handel	Royal Bank Of Scotland	(173)
	19.10.2016	EUR	2.695.549	USD	3.028.870	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.213
	19.10.2016	EUR	15.971.154	USD	17.946.083	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19.039
	19.10.2016	EUR	17.791.751	USD	19.991.808	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21.209
	19.10.2016	EUR	112.193	USD	126.306	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(106)
	19.10.2016	EUR	18.164	USD	20.449	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
	19.10.2016	EUR	142.911	USD	160.959	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(207)
	19.10.2016	EUR	120.286	USD	135.478	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(174)
	19.10.2016	EUR	211.329	USD	237.939	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(227)
	19.10.2016	EUR	52.978	USD	59.649	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(57)
	19.10.2016	EUR	67.867	USD	75.857	Absicherung	JP Morgan Chase New York	483
	19.10.2016	EUR	58.774	USD	65.694	Absicherung	JP Morgan Chase New York	418
								USD (21.871)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(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 Focus								
	19.10.2016	EUR	16.996.660	USD	19.098.399	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20.261
	19.10.2016	EUR	536.685	USD	603.050	Absicherung	JP Morgan Chase New York	640
	19.10.2016	USD	1.951	EUR	1.733	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2016	EUR	8.194	USD	9.229	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
	19.10.2016	USD	12.856	EUR	11.418	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	19.10.2016	EUR	3.593	USD	4.015	Absicherung	JP Morgan Chase New York	26
	19.10.2016	USD	148	EUR	132	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2016	USD	3.611	EUR	3.229	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21)
	19.10.2016	EUR	39.857	USD	44.452	Absicherung	JP Morgan Chase New York	381
	19.10.2016	USD	997	EUR	886	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	USD	12.210	EUR	10.871	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	19.10.2016	EUR	129.605	USD	146.191	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(405)
	19.10.2016	USD	35	EUR	31	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	EUR	19.488	USD	21.824	Absicherung	JP Morgan Chase New York	98
	19.10.2016	EUR	19.281	USD	21.666	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
								USD 20.984
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities								
	19.10.2016	EUR	232.724	USD	261.502	Absicherung	JP Morgan Chase New York	277
	19.10.2016	EUR	336.419	USD	378.018	Absicherung	JP Morgan Chase New York	401
	19.10.2016	EUR	54.634	USD	61.390	Absicherung	JP Morgan Chase New York	65
	19.10.2016	EUR	185.483	USD	208.909	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(268)
	19.10.2016	EUR	5.000	USD	5.619	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
								USD 481
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies								
	19.10.2016	GBP	79.934	EUR	93.989	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.641)
	19.10.2016	GBP	1.167.563	EUR	1.372.867	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23.964)
	19.10.2016	GBP	43.492	EUR	51.140	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(893)
	19.10.2016	GBP	3.743.500	EUR	4.389.524	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(64.601)
								EUR (91.099)
Threadneedle (Lux) - American								
	19.10.2016	EUR	7.516	USD	8.416	Absicherung	JP Morgan Chase New York	39
	19.10.2016	EUR	3.657	USD	4.087	Absicherung	JP Morgan Chase New York	26
	19.10.2016	USD	2.144	EUR	1.904	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2016	EUR	74	USD	83	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	USD	2.321	EUR	2.061	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2016	USD	2.016	EUR	1.790	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2016	USD	460.981	EUR	409.473	Absicherung	JP Morgan Chase New York	385
	19.10.2016	USD	125	EUR	112	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2016	USD	994	EUR	889	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.10.2016	EUR	28.786	USD	32.105	Absicherung	JP Morgan Chase New York	275
	19.10.2016	USD	14.219	EUR	12.636	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.10.2016	USD	175.542	EUR	155.996	Absicherung	JP Morgan Chase New York	70
	19.10.2016	EUR	34	USD	38	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	USD	7.027	EUR	6.257	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.10.2016	USD	34.210	EUR	30.329	Absicherung	JP Morgan Chase New York	95

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(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 (Fortsetzung)								
	19.10.2016	EUR	7.345	USD	8.285	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
	19.10.2016	EUR	2.449	USD	2.744	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.10.2016	USD	5.559	EUR	4.960	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
	19.10.2016	USD	336.450	EUR	300.185	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.211)
	19.10.2016	USD	14.071	EUR	12.565	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(63)
	19.10.2016	EUR	3.204	USD	3.600	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.10.2016	EUR	24.154.519	USD	27.141.370	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28.793
	19.10.2016	EUR	2.608.348	USD	2.930.886	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.109
	19.10.2016	EUR	2.318.084	USD	2.604.729	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.763
								USD 34.248
Threadneedle (Lux) - American Select								
	19.10.2016	EUR	199.345	USD	223.995	Absicherung	JP Morgan Chase New York	238
	19.10.2016	EUR	240.224	USD	269.930	Absicherung	JP Morgan Chase New York	286
	19.10.2016	EUR	81.397	USD	91.462	Absicherung	JP Morgan Chase New York	97
	19.10.2016	EUR	84	USD	95	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	USD	129.689	EUR	114.975	Absicherung	JP Morgan Chase New York	359
								USD 980
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity								
	19.10.2016	SGD	7.086	USD	5.186	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.10.2016	SGD	47.626	USD	34.851	Absicherung	JP Morgan Chase New York	85
	19.10.2016	SGD	7.456	USD	5.475	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.10.2016	USD	1.144	SGD	1.555	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2016	SGD	8.328	USD	6.090	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.10.2016	SGD	2.500	USD	1.834	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	USD	6.298	SGD	8.594	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.10.2016	EUR	4.007	USD	4.502	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
								USD 113
Threadneedle (Lux) - Asian Focus								
	19.10.2016	USD	421	SGD	570	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2016	EUR	3.962	USD	4.452	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2016	SGD	7.018	USD	5.135	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	19.10.2016	EUR	3.802	USD	4.272	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2016	SGD	348.366	USD	254.929	Absicherung	JP Morgan Chase New York	615
								USD 640
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income								
	19.10.2016	SGD	135.740	USD	100.280	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(708)
	19.10.2016	SGD	21.464	USD	15.788	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43)
	19.10.2016	USD	73.246	SGD	99.728	Absicherung	JP Morgan Chase New York	91
	19.10.2016	USD	42.246	SGD	57.642	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(38)
	19.10.2016	AUD	1.309.384	USD	977.351	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24.211
	19.10.2016	AUD	2.268.848	USD	1.693.514	Absicherung	JP Morgan Chase New York	41.950
	19.10.2016	EUR	3.871	USD	4.349	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(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)								
	19.10.2016	SGD	6.850	USD	5.013	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	19.10.2016	SGD	1.686.451	USD	1.234.117	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.977
	19.10.2016	SGD	21.795.922	USD	15.949.900	Absicherung	JP Morgan Chase New York	38.476
	19.10.2016	AUD	76	USD	58	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	USD	547	SGD	745	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	SGD	145.875	USD	107.117	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(111)
	19.10.2016	USD	4.405	SGD	5.997	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.10.2016	SGD	56.383	USD	41.416	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(56)
	19.10.2016	AUD	614	USD	469	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2016	SGD	21.378	USD	15.728	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(46)
	19.10.2016	USD	187.848	SGD	255.312	Absicherung	JP Morgan Chase New York	564
								USD 107.291
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities								
	19.10.2016	USD	402.690	EUR	359.285	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.450)
	19.10.2016	EUR	11	USD	12	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	USD	1.373.560	EUR	1.220.617	Absicherung	JP Morgan Chase New York	551
	19.10.2016	USD	3.382	EUR	3.024	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
	19.10.2016	EUR	6.051	USD	6.799	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.10.2016	GBP	2.151	USD	2.842	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(47)
	19.10.2016	CHF	2.117	USD	2.170	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16
	19.10.2016	EUR	13.246.733	USD	14.884.770	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15.791
	19.10.2016	CHF	69.066	USD	70.791	Absicherung	JP Morgan Chase New York	537
	19.10.2016	EUR	11.797	USD	13.256	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14
	19.10.2016	SGD	38.660	USD	28.291	Absicherung	JP Morgan Chase New York	68
	19.10.2016	EUR	286.576	USD	322.013	Absicherung	JP Morgan Chase New York	342
								USD 15.810
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities								
	19.10.2016	USD	2.125	EUR	1.891	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2016	SGD	18.108.718	EUR	11.793.294	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15.974
	19.10.2016	EUR	12.932	SGD	19.694	Absicherung	JP Morgan Chase New York	89
	19.10.2016	USD	200	EUR	179	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2016	SGD	6.371	EUR	4.136	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.10.2016	EUR	36.261	USD	40.530	Absicherung	JP Morgan Chase New York	230
	19.10.2016	EUR	16.736	SGD	25.585	Absicherung	JP Morgan Chase New York	51
	19.10.2016	EUR	90.226	SGD	138.522	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(109)
	19.10.2016	EUR	10.979	SGD	16.872	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24)
	19.10.2016	EUR	11.363	SGD	17.461	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24)
	19.10.2016	USD	3.382.022	EUR	3.009.837	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.190)
	19.10.2016	SGD	1.443	EUR	942	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2016	EUR	17.211	SGD	26.099	Absicherung	JP Morgan Chase New York	191
	19.10.2016	EUR	72	SGD	109	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	EUR	6.766	SGD	10.326	Absicherung	JP Morgan Chase New York	32
	19.10.2016	EUR	1.573	SGD	2.411	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(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 Equities (Fortsetzung)								
	19.10.2016	USD	359	EUR	318	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2016	EUR	3.310	SGD	5.051	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17
	19.10.2016	EUR	13.496	SGD	20.582	Absicherung	JP Morgan Chase New York	74
								EUR 13.327
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities								
	19.10.2016	SGD	13.530.765	EUR	8.811.902	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11.936
	19.10.2016	SGD	1.076	EUR	700	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2016	EUR	45.733	SGD	70.284	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(101)
	19.10.2016	SGD	13.877	EUR	9.039	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
	19.10.2016	EUR	2.835	SGD	4.334	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.10.2016	EUR	71.410	SGD	110.009	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(332)
	19.10.2016	EUR	3.923	SGD	5.974	Absicherung	JP Morgan Chase New York	27
	19.10.2016	EUR	15.291	SGD	23.187	Absicherung	JP Morgan Chase New York	170
	19.10.2016	SGD	99.294	EUR	65.188	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(435)
	19.10.2016	SGD	13.601	EUR	8.912	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
	19.10.2016	SGD	74.342	EUR	48.490	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.10.2016	SGD	76.144	EUR	49.905	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(249)
	19.10.2016	SGD	23.000	EUR	15.082	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(83)
	19.10.2016	SGD	4.868	EUR	3.180	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
								EUR 10.898
Threadneedle (Lux) - European Select								
	19.10.2016	GBP	4.817	EUR	5.589	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
	19.10.2016	GBP	6.816	EUR	7.875	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	USD	634.532	EUR	564.703	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(598)
	19.10.2016	GBP	31.760	EUR	37.345	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(652)
	19.10.2016	GBP	2.667.896	EUR	3.137.018	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(54.757)
	19.10.2016	GBP	2.559	EUR	2.998	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
	19.10.2016	GBP	800	EUR	937	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.10.2016	GBP	2.643	EUR	3.095	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
	19.10.2016	GBP	4.810	EUR	5.614	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(57)
	19.10.2016	GBP	9.750	EUR	11.298	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(34)
	19.10.2016	GBP	8.711	EUR	10.130	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(66)
	19.10.2016	EUR	2.522	GBP	2.165	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20
	19.10.2016	GBP	3.134	EUR	3.606	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14
	19.10.2016	EUR	2.182	GBP	1.883	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
								EUR (56.243)
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income								
	19.10.2016	EUR	246.595	USD	277.089	Absicherung	JP Morgan Chase New York	294
	19.10.2016	GBP	15.573	USD	20.575	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(339)
	19.10.2016	EUR	299	USD	336	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	EUR	12.793	USD	14.357	Absicherung	JP Morgan Chase New York	33
	19.10.2016	EUR	12.817	USD	14.383	Absicherung	JP Morgan Chase New York	34

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung Gekauft	Betrag Gekauft	Währung Verkauft	Betrag Verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income (Fortsetzung)								
	19.10.2016	GBP	818	USD	1.068	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	19.10.2016	USD	1.475	EUR	1.316	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	19.10.2016	EUR	3.600	USD	4.031	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	19.10.2016	EUR	247.188	USD	277.756	Absicherung	JP Morgan Chase New York	295
								USD 325
Threadneedle (Lux) - Greater China Equities								
	19.10.2016	EUR	196.693	USD	221.016	Absicherung	JP Morgan Chase New York	234
	19.10.2016	EUR	334.248	USD	375.579	Absicherung	JP Morgan Chase New York	398
	19.10.2016	EUR	1.998	USD	2.250	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.10.2016	USD	2.278	EUR	2.035	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.10.2016	EUR	300	USD	336	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2016	EUR	248	USD	277	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2016	EUR	200	USD	224	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
								USD 624
Threadneedle (Lux) - Global Energy Equities								
	19.10.2016	EUR	1.050	USD	1.177	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.10.2016	EUR	340	USD	383	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	EUR	5	USD	5	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	USD	20.510	EUR	18.317	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(94)
	19.10.2016	EUR	909	USD	1.018	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2016	EUR	1.000	USD	1.118	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.10.2016	USD	2.227	EUR	1.991	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.10.2016	USD	8.940	EUR	7.945	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.10.2016	EUR	585	USD	658	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	USD	204	EUR	182	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	EUR	1.075	USD	1.213	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.10.2016	EUR	300	USD	338	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	EUR	450	USD	507	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2016	EUR	198	USD	223	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	EUR	9.380.649	USD	10.540.621	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11.181
	19.10.2016	EUR	1.481.524	USD	1.664.724	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.766
	19.10.2016	EUR	3.060	USD	3.439	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2016	EUR	198	USD	222	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
								USD 12.859
Threadneedle (Lux) - Global Technology								
	19.10.2016	EUR	221.117	USD	248.459	Absicherung	JP Morgan Chase New York	264
								USD 264
Threadneedle (Lux) - UK Equities								
	19.10.2016	EUR	398.721	GBP	340.468	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.651
	19.10.2016	EUR	614.510	GBP	524.730	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7.168
	19.10.2016	EUR	25.000	GBP	21.419	Absicherung	JP Morgan Chase New York	220
	19.10.2016	GBP	12.000	EUR	13.905	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(36)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(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)	19.10.2016	EUR	19.975	GBP	17.178	Absicherung	JP Morgan Chase New York	112
	19.10.2016	EUR	390	GBP	335	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.10.2016	GBP	1.550	EUR	1.806	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.10.2016	EUR	3.529	GBP	3.057	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2016	EUR	510.885	GBP	443.944	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.740)
	19.10.2016	EUR	6.128.599	GBP	5.212.103	Absicherung	JP Morgan Chase New York	92.597
	19.10.2016	EUR	1.858.263	GBP	1.580.371	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28.076
	19.10.2016	USD	4.735.366	GBP	3.583.985	Absicherung	JP Morgan Chase New York	59.854
	19.10.2016	EUR	4.191.998	GBP	3.565.110	Absicherung	JP Morgan Chase New York	63.336
	19.10.2016	CHF	204.620	GBP	158.733	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.877
	19.10.2016	EUR	470.100	GBP	401.175	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.727
	19.10.2016	EUR	1.403	GBP	1.198	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17
	19.10.2016	EUR	868.977	GBP	742.036	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10.119
	19.10.2016	USD	248.642	GBP	188.512	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.817
	19.10.2016	EUR	27.715	GBP	23.909	Absicherung	JP Morgan Chase New York	81
	19.10.2016	EUR	9.735	GBP	8.398	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28
	19.10.2016	EUR	465.236	GBP	401.337	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.355
	19.10.2016	EUR	500	GBP	431	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2016	GBP	3.473	EUR	4.012	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	EUR	214.671	GBP	185.810	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2016	EUR	6.059	GBP	5.168	Absicherung	JP Morgan Chase New York	77
	19.10.2016	EUR	7.668	GBP	6.539	Absicherung	JP Morgan Chase New York	98
	19.10.2016	GBP	648.147	USD	855.660	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10.284)
								GBP 268.141
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha								
	19.10.2016	EUR	16.055.824	USD	18.041.222	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19.139
	19.10.2016	CHF	242.913	USD	248.980	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.887
	19.10.2016	GBP	41.371.007	USD	54.661.733	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(897.874)
	19.10.2016	EUR	1.444.352	USD	1.622.954	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.722
	19.10.2016	EUR	23.933.065	USD	26.892.533	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28.528
	19.10.2016	GBP	35.167.394	USD	46.465.166	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(763.238)
	19.10.2016	GBP	217.413	USD	287.258	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.719)
	19.10.2016	EUR	3.675	USD	4.137	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.10.2016	USD	11.273	EUR	10.009	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14
	19.10.2016	EUR	27.300	USD	30.748	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(39)
	19.10.2016	GBP	2.021	USD	2.666	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(39)
	19.10.2016	GBP	1.320	USD	1.743	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(27)
	19.10.2016	GBP	6.667	USD	8.726	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(63)
	19.10.2016	EUR	14.700	USD	16.460	Absicherung	JP Morgan Chase New York	75
	19.10.2016	EUR	31.850	USD	35.623	Absicherung	JP Morgan Chase New York	204
	19.10.2016	EUR	5.781	USD	6.447	Absicherung	JP Morgan Chase New York	55
	19.10.2016	USD	5.634	EUR	5.007	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2016	EUR	2.250	USD	2.532	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2016	GBP	1.067	USD	1.398	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
	19.10.2016	EUR	32.143	USD	36.101	Absicherung	JP Morgan Chase New York	55
	19.10.2016	EUR	294	USD	332	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(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								
(Fortsetzung)	19.10.2016	USD	2.764	EUR	2.466	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.10.2016	USD	39.045	EUR	34.836	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(141)
	19.10.2016	EUR	6.860	USD	7.689	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28
	19.10.2016	USD	122.847	EUR	109.702	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(550)
	19.10.2016	USD	22.697	EUR	20.198	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
								USD (1.615.031)
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia*								
	19.10.2016	CHF	9.354	USD	9.587	Absicherung	JP Morgan Chase New York	73
	19.10.2016	EUR	1.076.635	USD	1.209.768	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.283
	19.10.2016	SGD	12.932	USD	9.464	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23
	19.10.2016	AUD	12.870	USD	9.606	Absicherung	JP Morgan Chase New York	238
	19.10.2016	GBP	900.803	USD	1.190.192	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19.550)
	19.10.2016	EUR	1.076.963	USD	1.210.136	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.284
	19.10.2016	EUR	1.074.588	USD	1.207.467	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.281
	19.10.2016	EUR	1.085.407	USD	1.219.625	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.294
	19.10.2016	EUR	1.075.816	USD	1.208.847	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.282
								USD (12.792)
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond								
	25.11.2016	CNY	714.024	USD	106.890	Handel	HSBC	(308)
	25.11.2016	CNY	549.520	USD	82.000	Handel	HSBC	27
	06.12.2016	USD	2.226.067	CNY	14.972.525	Handel	HSBC	(7.538)
	06.12.2016	USD	131.766	GBP	98.764	Handel	Royal Bank Of Scotland	3.291
	19.10.2016	EUR	5.030.740	USD	5.652.821	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.997
	19.10.2016	GBP	2.279.478	USD	3.011.777	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(49.472)
	19.10.2016	EUR	3.535.014	USD	3.972.140	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.214
	19.10.2016	EUR	20.124.323	USD	22.612.816	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23.988
	19.10.2016	CHF	234.321	USD	240.173	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.820
	19.10.2016	GBP	50.853	USD	67.190	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.104)
	19.10.2016	USD	254.310	EUR	225.895	Absicherung	JP Morgan Chase New York	213
	19.10.2016	USD	141.821	EUR	125.918	Absicherung	JP Morgan Chase New York	182
	19.10.2016	USD	1.526	EUR	1.355	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2016	USD	145.921	EUR	129.602	Absicherung	JP Morgan Chase New York	139
	19.10.2016	USD	149	EUR	132	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	21.10.2016	USD	1.125.211	IDR	14.858.968.737	Handel	UBS AG Stamford Branch	(14.164)
	21.10.2016	USD	3.503.666	RUB	229.824.715	Handel	Citibank	(126.999)
	19.10.2016	USD	117.753	EUR	105.350	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(749)
	21.10.2016	MXN	19.836.257	USD	1.011.347	Handel	Citibank	11.053
	21.10.2016	SEK	21.163.871	USD	2.475.319	Handel	UBS AG Stamford Branch	(2.342)
	21.10.2016	USD	4.117.600	AUD	5.463.761	Handel	Citibank	(61.509)
	21.10.2016	USD	1.739.063	CAD	2.286.578	Handel	HSBC	(1.085)
	21.10.2016	USD	6.682	CHF	6.539	Handel	Goldman Sachs	(72)
	21.10.2016	USD	2.523.205	EUR	2.256.450	Handel	UBS AG Stamford Branch	(15.197)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(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)	21.10.2016	USD	11.171.352	GBP	8.555.362	Handel	Royal Bank Of Scotland	52.693
	21.10.2016	USD	2.023.606	HUF	557.592.582	Handel	Royal Bank Of Scotland	(3.856)
	21.10.2016	USD	1.218.563	JPY	123.903.191	Handel	UBS AG Stamford Branch	(6.070)
	21.10.2016	USD	6.683.683	NZD	9.158.477	Handel	Royal Bank Of Scotland	29.599
	19.10.2016	USD	2.793	EUR	2.494	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	21.10.2016	USD	963.996	EUR	861.130	Handel	Citibank	(4.737)
	19.10.2016	USD	14.194	EUR	12.690	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(81)
	21.10.2016	JPY	123.521.727	EUR	1.083.970	Handel	UBS AG Stamford Branch	1.442
	21.10.2016	USD	690.534	EUR	618.615	Handel	Citibank	(5.379)
	21.10.2016	USD	681.383	RUB	44.214.938	Handel	UBS AG Stamford Branch	(17.071)
	19.10.2016	USD	251.440	EUR	225.450	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.155)
	19.10.2016	USD	2.090	EUR	1.874	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
	19.10.2016	USD	4.810	EUR	4.313	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(41)
	21.10.2016	GBP	120.129	EUR	139.652	Handel	Royal Bank of Canada	(981)
	21.10.2016	GBP	1.789.341	EUR	2.082.657	Handel	UBS AG Stamford Branch	(17.443)
	21.10.2016	NOK	19.037.542	EUR	2.084.011	Handel	Barclays Capital	37.679
	19.10.2016	USD	277.531	EUR	246.628	Absicherung	JP Morgan Chase New York	111
	19.10.2016	USD	519.078	EUR	462.173	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(795)
	25.11.2016	CNY	3.744.426	USD	557.746	Handel	HSBC	1.181
	21.10.2016	NZD	529.824	USD	383.525	Handel	Goldman Sachs	1.420
	21.10.2016	USD	191.833	GBP	148.092	Handel	HSBC	(629)
	21.10.2016	USD	176.887	SEK	1.509.931	Handel	Royal Bank of Canada	453
	19.10.2016	USD	96.634	EUR	85.671	Absicherung	JP Morgan Chase New York	267
	19.10.2016	USD	100.730	EUR	89.302	Absicherung	JP Morgan Chase New York	279
	19.10.2016	USD	52.118	EUR	46.500	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(188)
	21.10.2016	GBP	1.897.258	USD	2.471.679	Handel	Goldman Sachs	(5.984)
	19.10.2016	USD	565.484	EUR	504.972	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.531)
	19.10.2016	USD	56.962	EUR	50.691	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(57)
	21.10.2016	EUR	1.993.551	NOK	18.049.612	Handel	Citibank	(15.861)
	21.10.2016	EUR	2.053.358	SEK	19.782.547	Handel	UBS AG Stamford Branch	(1.622)
	21.10.2016	GBP	1.720.747	EUR	1.993.426	Handel	UBS AG Stamford Branch	(6.220)
	21.10.2016	USD	894.799	MXN	17.597.122	Handel	Citibank	(12.222)
	25.11.2016	USD	5.454.819	CNY	36.236.361	Handel	HSBC	46.031
								USD (162.412)
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha*								
	19.10.2016	GBP	3.833	EUR	4.442	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.10.2016	GBP	10.816.884	EUR	12.534.179	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(37.272)
	19.10.2016	GBP	3.833	EUR	4.442	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.10.2016	USD	43.919	EUR	39.265	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(221)
								EUR (37.519)
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities								
	19.10.2016	SEK	642.737.896	USD	75.618.528	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(522.961)
	19.10.2016	EUR	1.914.117	USD	2.150.809	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.282

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(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)								
	19.10.2016	CHF	704.134	USD	721.720	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.470
	19.10.2016	EUR	10.110	USD	11.382	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.10.2016	USD	21.310	GBP	16.153	Absicherung	JP Morgan Chase New York	318
	19.10.2016	GBP	8.278	USD	10.921	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(163)
	19.10.2016	USD	13.727	EUR	12.188	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	19.10.2016	EUR	125	USD	141	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	USD	13.816	GBP	10.475	Absicherung	JP Morgan Chase New York	203
	19.10.2016	GBP	5.474	USD	7.220	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(106)
	19.10.2016	EUR	27.969	USD	31.491	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(30)
	19.10.2016	USD	41.640	GBP	31.542	Absicherung	JP Morgan Chase New York	650
	19.10.2016	EUR	125	USD	141	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	GBP	63.837	USD	84.275	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.316)
	19.10.2016	SGD	2.714	USD	1.991	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	USD	7.658	GBP	5.801	Absicherung	JP Morgan Chase New York	120
	19.10.2016	USD	476	EUR	426	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.10.2016	CHF	179	USD	183	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2016	USD	11.797	GBP	9.012	Absicherung	JP Morgan Chase New York	85
	19.10.2016	EUR	125	USD	140	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2016	USD	50	GBP	38	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	GBP	8.883.693	USD	11.737.641	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(192.803)
	19.10.2016	SGD	1.018.171	USD	745.081	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.797
	19.10.2016	GBP	1.447.528	USD	1.912.557	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(31.416)
	19.10.2016	GBP	57.195.159	USD	75.569.506	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.241.308)
	19.10.2016	CHF	252.068	USD	258.363	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.958
	19.10.2016	EUR	19.372.478	USD	21.768.001	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23.092
	19.10.2016	EUR	2.358.237	USD	2.649.847	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.811
	19.10.2016	GBP	974.754	USD	1.287.901	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21.155)
	19.10.2016	CHF	1.047.845	USD	1.074.015	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8.140
	19.10.2016	EUR	4.561.111	USD	5.125.119	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.437
	19.10.2016	USD	2.239	GBP	1.725	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.10.2016	EUR	230.513	USD	259.032	Absicherung	JP Morgan Chase New York	260
	19.10.2016	EUR	199.978	USD	224.719	Absicherung	JP Morgan Chase New York	226
	19.10.2016	GBP	85.000	USD	110.354	Absicherung	JP Morgan Chase New York	108
	19.10.2016	USD	27.757	GBP	21.365	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.10.2016	USD	239	EUR	213	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.10.2016	CHF	1.145	USD	1.177	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.10.2016	EUR	200	USD	224	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2016	GBP	7.156	USD	9.298	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.10.2016	GBP	7	USD	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	EUR	123	USD	138	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2016	USD	20.951	GBP	16.125	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.10.2016	CHF	149	USD	153	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	GBP	6.496	USD	8.432	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.10.2016	USD	20.706	GBP	15.951	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
	19.10.2016	USD	6.086	GBP	4.693	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.10.2016	USD	5.932	GBP	4.574	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.10.2016	EUR	25.000	USD	28.078	Absicherung	JP Morgan Chase New York	43

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)	19.10.2016	CHF	39	USD	40	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	GBP	124.374	USD	163.002	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.371)
	19.10.2016	USD	7.895	SGD	10.686	Absicherung	JP Morgan Chase New York	56
	19.10.2016	USD	8.000	GBP	6.104	Absicherung	JP Morgan Chase New York	67
	19.10.2016	EUR	600	USD	675	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	EUR	7.500	USD	8.440	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.10.2016	GBP	400	USD	524	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.10.2016	GBP	29.737	USD	38.566	Absicherung	JP Morgan Chase New York	79
	19.10.2016	USD	52.907	GBP	40.795	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(109)
	19.10.2016	EUR	19.985	USD	22.289	Absicherung	JP Morgan Chase New York	191
	19.10.2016	EUR	100	USD	112	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2016	CHF	14.499	USD	14.981	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	19.10.2016	EUR	39.798	USD	44.744	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23
	19.10.2016	SEK	13.452.877	USD	1.579.311	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7.517)
	19.10.2016	GBP	186.102	USD	243.349	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.499)
	19.10.2016	SGD	21.092	USD	15.583	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(111)
	19.10.2016	GBP	30.648	USD	40.075	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(247)
	19.10.2016	GBP	1.197.496	USD	1.565.855	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9.643)
	19.10.2016	CHF	5.183	USD	5.355	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.10.2016	EUR	402.353	USD	452.355	Absicherung	JP Morgan Chase New York	231
	19.10.2016	EUR	48.484	USD	54.509	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28
	19.10.2016	GBP	19.390	USD	25.355	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(156)
	19.10.2016	CHF	21.348	USD	22.058	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.10.2016	EUR	94.132	USD	105.831	Absicherung	JP Morgan Chase New York	54
	19.10.2016	USD	2.893	EUR	2.586	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
	19.10.2016	USD	1.744	GBP	1.345	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	19.10.2016	EUR	200	USD	224	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2016	GBP	2.340	USD	3.059	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
	19.10.2016	USD	5.535	GBP	4.235	Absicherung	JP Morgan Chase New York	32
	19.10.2016	EUR	125	USD	140	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.10.2016	CHF	4	USD	4	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.10.2016	EUR	783	USD	877	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.10.2016	USD	21.903	GBP	16.733	Absicherung	JP Morgan Chase New York	157
								USD (1.978.090)

*Siehe Erläuterung 1.

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

Zum 30. September 2016 hatte Threadneedle (Lux) - Global Strategic 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	Goldman Sachs	Markit CDX.NA.HY.500BPS	Kaufen	USD	490.000	20.12.2021	(21.492)	(0,10)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Europe Crossover Series 21	Kaufen	EUR	2.400.000	20.12.2021	(210.019)	(1,00)
CDS	JPMorgan	Markit CDX	Kaufen	USD	2.025.000	20.06.2021	(28.747)	(0,14)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
CDS	HSBC	Japan (Regierung) 20/12/2016	Kaufen	USD	1.000.000	20.12.2016	(2.152)	(0,01)
							USD (262.410)	(1,25)

Zum 30. September 2016 hatte Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond den folgenden ausstehenden Zinsswap-Kontrakt:

Beschreibung	Kontrahent	Bezahlen	Erhalten	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
IRS	HSBC	BZDIOVRA	11,48 %	BRL	4.485.855	04.01.2021	6.117	0,03
							USD 6.117	0,03

Zum 30. September 2016 hatte Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/ Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
CDS	Goldman Sachs	Markit CDX.NA.HY.25 Index	Kaufen	USD	1.000.000	20.12.2020	(12.711)	(0,05)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA 2012/2019	Kaufen	EUR	100.000	20.12.2019	21.024	0,09
CDS	Citigroup Global Markets	Pearson plc 20/09/2020	Kaufen	EUR	225.000	20.09.2020	(2.390)	(0,01)
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Crossover Series 24	Kaufen	EUR	600.000	20.12.2020	(10.444)	(0,04)
CDS	Citigroup Global Markets	ITRAXX Europe Crossover Series 21	Kaufen	EUR	389.332	20.12.2020	(36.128)	(0,15)
CDS	Citigroup Global Markets	ITRAXX Europe Crossover Series 21	Kaufen	EUR	218.999	20.12.2020	(20.322)	(0,08)
CDS	Goldman Sachs	PostNL NV 20/12/2020	Kaufen	EUR	58.000	20.12.2020	(1.895)	(0,01)
CDS	Barclays	PostNL NV 20/12/2020	Kaufen	EUR	50.000	20.12.2020	(1.634)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	PostNL NV 20/12/2020	Kaufen	EUR	80.000	20.12.2020	(2.614)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Tesco plc 20/06/2021	Kaufen	EUR	200.000	20.06.2021	9.900	0,04
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 24	Kaufen	EUR	750.000	20.06.2021	(2.380)	(0,01)
CDS	Barclays	Metro AG 20/06/2021	Kaufen	EUR	75.000	20.06.2021	509	0,00
CDS	JPMorgan	Metro AG 20/06/2021	Kaufen	EUR	100.000	20.06.2021	678	0,00
CDS	Citigroup Global Markets	Metro AG 20/06/2021	Kaufen	EUR	165.000	20.06.2021	1.119	0,00
CDS	JPMorgan	RWE Finance II 20/06/2021	Kaufen	EUR	260.000	20.06.2021	(2.444)	(0,01)
							USD (59.732)	(0,25)

Zum 30. September 2016 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 USD	% des Netto- vermögens
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Crossover Series 21	Kaufen	EUR	6.500.000	20.06.2021	(506.706)	(0,73)
							EUR (506.706)	(0,73)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 hatte Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha den folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakt:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Bezahlen/Erhalten	Währung	Nennbetrag	Nicht realisierter (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	Bank of America Merrill Lynch	North America Equity Basket	Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 10 Aktien und Zahlung von US- 1M-LIBOR + 0,30 %. Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 28 Aktien und Erhalt des US- 1M-LIBOR.	USD	29.667.056	(475.473)	(0,29)
						USD (475.473)	(0,29)

Zum 30. September 2016 hatte das Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia* die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Bezahlen/Erhalten	Währung	Nennbetrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	Barclays	North America Commodities Basket	Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 8 Indizes und Zahlung von 0,15 % bis 0,70 %.	USD	11.253.859	(23.240)	(0,24)
TRS	Goldman Sachs	North America Commodities Basket	Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 20 Indizes und Zahlung von 0,11 % bis 0,35 %.	USD	31.850.749	70.532	0,72
TRS	Deutsche Bank	North America Commodities Basket	Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 12 Indizes.	USD	9.867.343	(15.699)	(0,16)
						USD 31.593	0,32

Zum 30. September 2016 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	Credit Agricole SA 20/12/2018	Kaufen	EUR	900.000	20.12.2018	(97.325)	(0,22)
CDS	HSBC	UBS AG 20/03/2019	Kaufen	EUR	1.125.000	20.03.2019	(69.557)	(0,16)
CDS	Goldman Sachs	Banco Commercial Portugues SA 20/09/2019	Kaufen	EUR	790.000	20.09.2019	24.913	0,06
CDS	Barclays	Monte Dei Paschi 20/12/2019	Kaufen	EUR	145.000	20.12.2019	46.994	0,11

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Marktwert USD	% des Netto- vermögens
CDS	JPMorgan	Monte Dei Paschi 20/12/2019	Kaufen	EUR	80.000	20.12.2019	25.928	0,06
CDS	JPMorgan	Monte Dei Paschi 20/12/2019	Kaufen	EUR	80.000	20.12.2019	25.928	0,06
CDS	JPMorgan	Gaz Natural Capital 20/03/2020	Kaufen	EUR	1.300.000	20.03.2020	(27.185)	(0,06)
CDS	JPMorgan	United Utilities plc 20/03/2020	Kaufen	EUR	920.000	20.03.2020	(20.259)	(0,05)
CDS	Barclays	RWE AG 20/03/2020	Kaufen	EUR	1.490.000	20.03.2020	(25.316)	(0,06)
CDS	Goldman Sachs	Westpac banking Corp. 20/03/2020	Kaufen	USD	1.700.000	20.03.2020	(33.145)	(0,08)
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc 20/06/2020	Kaufen	EUR	675.000	20.06.2020	15.587	0,04
CDS	Citigroup Global Markets	Pearson plc 20/09/2020	Kaufen	EUR	900.000	20.09.2020	(9.559)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	PostNL NV 20/12/2020	Kaufen	EUR	147.000	20.12.2020	(4.804)	(0,01)
CDS	Barclays	PostNL NV 20/12/2020	Kaufen	EUR	140.000	20.12.2020	(4.575)	(0,01)
CDS	Citigroup Global Markets	PostNL NV 20/12/2020	Kaufen	EUR	220.000	20.12.2020	(7.189)	(0,02)
CDS	HSBC	ITRAXX Europe Crossover Series 24	Kaufen	EUR	2.100.000	20.06.2021	(6.664)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Markit CDX.NA.HY.26 Index	Verkaufen	USD	1.700.000	20.06.2021	24.133	0,06
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Crossover Series 24	Kaufen	EUR	1.350.000	20.06.2021	(4.284)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	ITRAXX Europe Crossover Series 21	Kaufen	EUR	4.700.000	20.12.2021	(411.288)	(0,94)
CDS	Goldman Sachs	Markit CDX. NA.HY.500BPS	Kaufen	USD	2.960.000	20.12.2021	(129.832)	(0,30)
							USD (687.499)	(1,57)

Zum 30. September 2016 hatte Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond den folgenden ausstehenden Zinsswap-Kontrakt:

Beschreibung	Kontrahent	Bezahlen	Erhalten	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
IRS	HSBC	BZDIOVRA	11,48 %	BRL	9.921.813	04.01.2021	13.530	0,03
							USD 13.530	0,03

Zum 30. September 2016 hatte Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha* die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Bezahlen/Erhalten	Währung	Nennbetrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	Goldman Sachs	North America Equity Basket	Zahlung der Performance der zugrunde liegenden Aktien und Erhalt von 1M-TOIS-0,35 %.	CHF	185.445	1.973	0,01

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Bezahlen/Erhalten	Währung	Nennbetrag	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	Goldman Sachs	North America Equity Basket	Zahlung der Performance der zugrunde liegenden Aktien und Erhalt von 1M-DKKOIS-0,35 %.	DKK	2.241.557	10.029	0,06
TRS	Goldman Sachs	North America Equity Basket	Erhalt der Performance der zugrunde liegenden Aktien und Zahlung von 1M-EURIBOR+0,40 %. Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 16 Aktien und Erhalt von 1M-EONIA-0,35 % bis -1 %.	EUR	4.009.132	18.385	0,11
TRS	Goldman Sachs	North America Equity Basket	Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 19 Aktien und Zahlung von 1M-LIBOR+0,40 %. Zahlung der Performance der zugrunde liegenden Aktien und Erhalt von 1M-SONIA-0,35 %.	GBP	3.731.114	31.776	0,18
TRS	Goldman Sachs	North America Equity Basket	Zahlung der Performance der 2 zugrunde liegenden Aktien und Erhalt von 1M-STIBOR-0,35 %.	SEK	3.283.967	(2.496)	(0,01)
						EUR 59.667	0,35

Zum 30. September 2016 hatte Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Bezahlen/Erhalten	Währung	Nennbetrag	Nicht realisierter Gewinn in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	Citigroup Global Markets	North America Commodities Basket	Erhalt des BCOM BBG COMDTY BCOM Index und Zahlung von 0,11 %.	USD	32.909.303	894.834	0,23
TRS	Credit Suisse	North America Commodities Basket	Erhalt der Performance der 2 zugrunde liegenden Indizes und Zahlung von bis zu 0,25 %. Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Index.	USD	131.763.643	2.491.342	0,65
TRS	Goldman Sachs	North America Commodities Basket	Erhalt des BCOM BBG COMDTY BCOM Index und Zahlung von 0,11 %.	USD	58.607.937	1.593.603	0,41

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Bezahlen/Erhalten	Währung	Nennbetrag	Nicht realisierter Gewinn in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	JPMorgan	North America Commodities Basket	Erhalt der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 11 Indizes und Zahlung von bis zu 0,25 %. Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Korbes von 8 Indizes.	USD	695.188.157	2.024.028	0,53
TRS	Macquarie	North America Commodities Basket	Erhalt der Performance der 2 zugrunde liegenden Indizes und Zahlung von bis zu 0,17 %. Zahlung der Performance des zugrunde liegenden Index.	USD	128.289.577	2.480.550	0,64
						USD 9.484.357	2,46

*Siehe Erläuterung 1.

11 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

Zum 30. September 2016 ist die Gegenpartei von ausstehenden Terminkontrakten UBS.

Zum 30. September 2016 hatte Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio- Basiswährung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Nettover- mögens
Euro-Bund Future	Verkauf	(6)	EUR	(1.117.282)	08.12.2016	(9.575)	(0,05)
Euro-Bobl Future	Kauf	8	EUR	1.187.542	08.12.2016	3.237	0,02
Mid-Term Euro-BTP Future	Verkauf	(21)	EUR	(3.376.895)	08.12.2016	(3.034)	(0,01)
Euro-Buxl Future	Verkauf	(1)	EUR	(215.972)	08.12.2016	(9.125)	(0,04)
3-Year Australian Treasury Bond Future	Kauf	26	AUD	2.254.477	15.12.2016	3.450	0,02
10-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(11)	USD	(1.442.375)	20.12.2016	(2.063)	(0,01)
Ultra Treasury Bond Future	Kauf	3	USD	551.625	20.12.2016	10.124	0,04
						USD (6.986)	(0,03)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

11 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

(Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 hatte Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-Bobl Future	Verkauf	(8)	EUR	(1.187.542)	08.12.2016	(1.450)	(0,01)
Euro-Bund Future	Verkauf	(12)	EUR	(2.234.564)	08.12.2016	(7.552)	(0,03)
10-Year Australian Treasury Bond Future	Kauf	2	AUD	209.703	15.12.2016	2.161	0,01
Canadian Dollar Future	Kauf	1	CAD	111.790	19.12.2016	198	0,00
Ultra Treasury Bond Future	Verkauf	(1)	USD	(183.875)	20.12.2016	3.281	0,01
20-Year US Treasury Bond Future	Kauf	9	USD	1.513.406	20.12.2016	(12.531)	(0,04)
10-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(9)	USD	(1.180.125)	20.12.2016	(3.828)	(0,02)
Long Gilt Future	Verkauf	(8)	GBP	(1.353.558)	28.12.2016	3.105	0,01
5-Year U.S. Treasury Note Future	Kauf	19	USD	2.308.798	30.12.2016	7.867	0,03
						USD (8.749)	(0,04)

Zum 30. September 2016 hatte Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-Buxl Future	Verkauf	(18)	EUR	(3.459.240)	08.12.2016	(46.380)	(0,07)
Euro-Schatz Future	Verkauf	(95)	EUR	(10.652.825)	08.12.2016	(9.975)	(0,01)
Euro-Bobl Future	Kauf	140	EUR	18.492.600	08.12.2016	27.090	0,04
Mid-Term Euro-BTP Future	Verkauf	(19)	EUR	(2.718.710)	08.12.2016	(4.010)	(0,01)
Euro-Bund Future	Verkauf	(32)	EUR	(5.302.400)	08.12.2016	(18.760)	(0,03)
10-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(3)	USD	(350.040)	20.12.2016	(1.752)	0,00
Long Gilt Future	Verkauf	(11)	GBP	(1.656.116)	28.12.2016	13.605	0,02
						EUR (40.182)	(0,06)

Zum 30. September 2016 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	(67)	USD	(8.785.375)	20.12.2016	(14.656)	(0,02)
5-Year U.S. Treasury Note Future	Kauf	135	USD	16.404.609	30.12.2016	42.187	0,06
						USD 27.531	0,04

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

11 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

(Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 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 in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
10-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(2)	USD	(288.313)	20.12.2016	629	0,01
5-Year U.S. Treasury Note Future	Kauf	5	USD	607.579	30.12.2016	117	0,00
						USD 746	0,01

Zum 30. September 2016 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
5-Year U.S. Treasury Note Future	Kauf	13	USD	1.579.703	30.12.2016	(4.266)	(0,01)
						USD (4.266)	(0,01)

Zum 30. September 2016 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 (Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Nifty Bank Index Future	Kauf	168	USD	2.906.736	27.10.2016	(37.484)	(0,04)
TOPIX Banks Index Future	Kauf	41	JPY	5.356.540	08.12.2016	(42.917)	(0,05)
E-Mini S&P 500 Future	Verkauf	(145)	USD	(15.663.625)	16.12.2016	(277.675)	(0,34)
						USD (358.076)	(0,43)

Zum 30. September 2016 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 (Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
E-Mini S&P 500 Future	Verkauf	(231)	USD	(24.953.774)	16.12.2016	(160.513)	(0,10)
						USD (160.513)	(0,10)

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

11 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

(Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 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-Bobl Future	Verkauf	(25)	EUR	(3.711.069)	08.12.2016	(12.924)	(0,03)
Euro-Bund Future	Verkauf	(40)	EUR	(7.448.546)	08.12.2016	(57.404)	(0,14)
Mid-Term Euro-BTP Future	Verkauf	(44)	EUR	(7.075.400)	08.12.2016	(6.574)	(0,01)
Euro-Buxl Future	Verkauf	(5)	EUR	(1.079.859)	08.12.2016	(42.974)	(0,10)
Ultra Treasury Bond Future	Kauf	1	USD	183.875	20.12.2016	3.375	0,01
10-Year US Treasury Note Future	Verkauf	(42)	USD	(5.507.250)	20.12.2016	(7.875)	(0,02)
Long Gilt Future	Verkauf	(20)	GBP	(3.383.895)	28.12.2016	6.833	0,02
5-Year U.S. Treasury Note Future	Verkauf	(11)	USD	(1.336.672)	30.12.2016	(3.609)	(0,01)
						USD (121.152)	(0,28)

Zum 30. September 2016 hatte Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha* 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 STOXX 50 Future	Verkauf	(100)	EUR	(2.994.000)	16.12.2016	(30.000)	(0,18)
						EUR (30.000)	(0,18)

*Siehe Erläuterung 1.

12 OPTIONEN ZUM MARKTWERT

Zum 30. September 2016 hatte Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income die folgenden ausstehenden Optionen:

Beschreibung	Kontrahent	Basis	Währung	Kontrakte	Fälligkeitsdatum	Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Marktwert in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Optionen auf Futures								
Call S&P 500 Index	UBS AG	2.175,000	USD	(44)	20.10.2016	9.570.000*	(79.639)	(0,13)
Call DJ Euro Stoxx 50	UBS AG	3.000,000	EUR	(68)	21.10.2016	2.292.552*	(39.967)	(0,07)
Call FTSE 100 Index	UBS AG	6.850,000	GBP	(31)	21.10.2016	2.758.427*	(43.491)	(0,07)
						USD (163.097)	(0,27)	

*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 gebildet, indem von jedem der beteiligten Portfolios Barmittel oder sonstige Vermögenswerte (sofern diese Vermögenswerte mit der Anlagepolitik des betreffenden Pools in Einklang stehen) auf den Vermögenspool übertragen werden.

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

13 POOLING

(Fortsetzung)

Der Anteil eines beteiligten Portfolios am jeweiligen Vermögenspool wird durch Bezugnahme auf fiktive Einheiten gleichen Werts bewertet.

Zum 30. September 2016 setzte die SICAV folgende Vermögenspools ein:

Pool	Beteiligte Portfolios
World Equity Pool	100 % gehalten von Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation
Global Bonds US Pool	100 % gehalten von Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation

14 ÄNDERUNGEN BEI DER ZUSAMMENSETZUNG DER AUFSTELLUNGEN DER WERTPAPIERANLAGEN

Änderungen bei den Aufstellungen der Wertpapieranlagen werden den Anteilhabern 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 (im Sinne der Definition dieses Begriffs im Verkaufsprospekt) vorgenommen werden, um die Interessen der Anteilhaber 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 - Focused 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 Portfolio, 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 Berichtszeitraums war keine Verwässerungsanpassung vorgenommen worden.

16 TRANSAKTIONSKOSTEN

Für den Berichtszeitraum 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 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 ^{1,2}	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	19.741
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income ¹	USD	35.565
Threadneedle (Lux) - Global Focus	USD	171.736
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	USD	7.851
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	EUR	5.045
Threadneedle (Lux) - American	USD	166.260
Threadneedle (Lux) - American Select	USD	3.246
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	USD	40.747
Threadneedle (Lux) - Asian Focus	USD	43.458
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	USD	143.560

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

16 TRANSAKTIONSKOSTEN

(Fortsetzung)

Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	USD	183.763
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	EUR	131.532
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	EUR	235.944
Threadneedle (Lux) - European Select	EUR	10.714
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	USD	79.757
Threadneedle (Lux) - Greater China Equities	USD	2.724
Threadneedle (Lux) - Global Energy Equities	USD	6.529
Threadneedle (Lux) - Global Technology	USD	32.344
Threadneedle (Lux) - Global Equities - Walter Scott & Partners ²	EUR	87.702
Threadneedle (Lux) - Mondrian Investment Partners - Focused Emerging Markets Equity	USD	100.676
Threadneedle (Lux) - UK Equities	GBP	216.349
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity	USD	38.329
Threadneedle (Lux) - STANLIB Global Emerging Markets Property Securities	USD	52.841
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	USD	137.892
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia ^{1,2}	USD	k.A.
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond ¹	USD	k.A.
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha ²	EUR	6.737
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities ¹	USD	k.A.

Die Transaktionskosten sind in den Gesamtkosten der Anlage gemäß den Aufstellungen der Wertpapieranlagen enthalten. Der Betrag der während des Berichtszeitraums 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 30. September 2016 dargestellt:

Portfolios	Kontrahent	Anlagentyp	Währung	Barsicherheiten
Fällig von Maklern				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Goldman Sachs	Termingeschäfte und Swaps	USD	180.000
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	UBS	Termingeschäfte	USD	110.000
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	110.000
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	RBS	Termingeschäfte	USD	120.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Credit Suisse Int	Swaps	USD	2.290.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Macquarie	Swaps	USD	2.290.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Goldman Sachs	Swaps	USD	1.460.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Citi Global Mkts	Swaps	USD	820.000
Fällig an Makler				
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	Citi Global Mkts	Termingeschäfte	USD	30.000
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	Barclays Bank	Termingeschäfte	USD	70.000
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	Goldman Sachs	Termingeschäfte und Swaps	USD	220.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	USD	270.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Citi Global Mkts	Termingeschäfte	EUR	130.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Barclays Bank	Swaps	EUR	490.000
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond*	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	190.000
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	RBS	Termingeschäfte	USD	140.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Goldman Sachs	Termingeschäfte	USD	120.000
Threadneedle (Lux) - UK Equities	JPM Chase	Termingeschäfte	GBP	600.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Merill Lynch	Swaps	USD	340.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	1.600.000
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	Barclays Bank	Termingeschäfte und Swaps	USD	90.000

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

17 INFORMATIONEN ZU BARSICHERHEITEN (CASH COLLATERAL)

(Fortsetzung)

Portfolios	Kontrahent	Anlagentyp	Währung	Barsicherheiten
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	HSBC Bank	Termingeschäfte und Swaps	USD	100.000
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	Citi Global Mkts	Termingeschäfte und Swaps	USD	260.000
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	Goldman Sachs	Termingeschäfte und Swaps	USD	540.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	USD	550.000

*Siehe Erläuterung 1.

18 GEGENSEITIGE ANLAGEN IN PORTFOLIOS

Zum 30. September 2016 investieren das Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond Portfolio und der Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond Portfolio in Anteile des Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond* Portfolios und das Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation Portfolio investiert in Anteile des Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolios.

Der Wert der vom Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond Portfolio gehaltenen Anteile beläuft sich auf USD 1.786.257 und stellt 0,83 % des Nettovermögens des Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond* Portfolios dar.

Der Wert der vom Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation Portfolio gehaltenen Anteile beläuft sich auf USD 4.416.553 und stellt 1,14 % des Nettovermögens des Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolios dar.

Der Wert der vom Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond Portfolio gehaltenen Anteile beläuft sich auf USD 1.365.777 und stellt 0,64 % des Nettovermögens des Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond* Portfolios 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.

*Siehe Erläuterung 1.

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 Anteilklassen laufend belasteten Kommissionen und Kosten (Betriebskosten) rückblickend als prozentualen Anteil des Nettovermögens der Anteilklassen und wird anhand der folgenden Formel berechnet.

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

Die Gesamtkostenquote für den Berichtszeitraum bis zum 30. September 2016 beträgt:

Portfolio	Klasse	TER
Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond	AEH	1,20 %
	AU	1,20 %
	DEC	1,54 % ²
	DEH	1,58 % ²
	DU	1,57 % ²
	W	0,98 % ²
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	AEC	1,28 % ³
	AEH	1,28 % ³
	AKH	1,30 % ³
	AU	1,26 % ³
	AUP	1,26 % ³
	DEH	1,65 %
	DU	1,76 % ⁴
	IEH	0,70 %

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

19 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond		
(Fortsetzung)	IGH	0,70 %
	IKH	0,70 %
	IU	0,70 %
	ZGH	0,84 % ³
	ZU	0,84 % ³
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	AE	1,15 %
	AEP	1,15 %
	DE	1,75 %
	DEP	1,75 %
	IE	0,66 % ³
	W	1,15 %
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	AEC	1,76 % ³
	AEH	1,75 % ³
	ASH	1,76 % ³
	AU	1,75 % ³
	AUP	1,76 % ³
	DEC	2,30 %
	DEH	2,30 %
	DU	2,30 %
	IEH	1,00 %
	P	1,30 %
	W	1,30 %
	WEH	1,30 %
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	AEC	1,76 % ³
	AEH	1,74 % ³
	ASH	1,72 % ³
	AU	1,76 % ³
	AUP	1,76 % ³
	DEH	2,30 %
	DU	2,30 %
	IEH	1,00 %
	SU	1,80 %
	SUP	1,80 %
	W	1,30 %
	ZU	0,90 %
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	AEC	1,67 % ³
	AEH	1,67 % ³
	ASC	1,67 % ³
	ASH	1,60 %
	AU	1,66 % ³
	AUP	1,67 % ³
	DEH	1,85 %
	DU	1,85 %
	IEH	1,00 %
	W	1,45 %
	ZEH	0,90 %
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond¹	AEC	1,55 %
	AEH	1,55 %
	ASH	1,55 %
	AU	1,55 %
	AUP	1,55 %

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

19 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond¹		
(Fortsetzung)	DEC	2,55 %
	DEH	2,55 %
	DU	2,55 %
	IEH	0,73 % ³
	ZGH	0,90 %
	ZU	0,90 %
Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond¹	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 %
	ZEH	0,70 %
	ZU	0,70 %
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	AEH	1,44 % ⁵
	ASC	1,55 %
	ASH	1,55 %
	AU	1,44 % ⁵
	AUP	1,55 %
	DEH	2,05 %
	IEH	1,00 %
	IGH	1,00 %
	ISH	1,00 %
	IU	0,91 % ⁵
	ZU	0,90 %
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation	AEC	1,81 % ³
	AEH	1,81 % ³
	AU	1,81 % ³
	AUP	1,81 % ³
	DEH	2,60 %
	DU	2,60 %
	IGH	0,95 %
	IU	0,95 %
	W	1,75 %
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	AEC	1,55 %
	AEH	1,55 %
	AEP	1,55 %
	AU	1,55 %
	AUP	1,55 %
	DEC	2,30 %
	DEP	2,30 %
	DU	2,30 %
	DUP	2,30 %
Threadneedle (Lux) - Global Focus	AEH	1,85 %
	AEP	1,85 %
	AU	1,85 %
	DEH	2,60 %
	DU	2,60 %
	W	1,75 %

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

19 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER
Threadneedle (Lux) - Global Focus		
(Fortsetzung)	XU	0,05 % ⁴
	ZE	1,10 %
	ZEP	1,10 %
	ZG	1,10 %
	ZU	1,10 %
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	AEH	1,85 %
	AU	1,85 %
	DEH	2,85 %
	DU	2,85 %
	IEH	1,10 %
	W	2,00 %
	ZU	1,10 %
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	AE	1,85 %
	AGH	1,78 % ⁵
	DE	2,35 %
	IE	0,95 %
	IGH	0,95 %
	ZGH	1,10 %
Threadneedle (Lux) - American	AEH	1,85 %
	AU	1,85 %
	DEH	2,35 %
	DU	2,35 %
	IEH	1,01 % ³
	IU	1,01 % ³
	W	1,50 %
Threadneedle (Lux) - American Select	AEH	1,85 %
	AU	1,85 %
	DEH	2,60 %
	DU	2,60 %
	IEH	1,05 %
	W	1,75 %
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	AE	1,85 %
	AF	1,85 %
	ASH	1,85 %
	AU	1,85 %
	DE	2,85 %
	IE	1,10 %
	IF	1,10 %
	ISH	1,10 %
	IU	1,10 %
	ZE	1,04 % ⁴
	ZEH	1,10 %
	ZF	1,10 %
	ZU	1,10 %
Threadneedle (Lux) - Asian Focus	AE	1,85 %
	AF	1,85 %
	ASH	1,85 %
	AU	1,85 %
	DE	2,85 %
	DEH	2,85 %
	IE	1,10 %
	IF	1,10 %
	ISH	1,10 %

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

19 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER
Threadneedle (Lux) - Asian Focus		
(Fortsetzung)	IU	1,10 %
	ZE	1,10 %
	ZEH	1,10 %
	ZF	1,10 %
	ZU	1,10 %
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income	AE	1,85 %
	AEP	1,85 %
	AF	1,85 %
	AFP	1,85 %
	ASC	1,85 %
	ASH	1,85 %
	AU	1,85 %
	AUP	1,85 %
	AVC	1,85 %
	AVH	1,85 %
	DE	2,85 %
	IE	1,10 %
	IEP	1,10 %
	IF	1,10 %
	IFP	1,10 %
	ISH	1,10 %
	IU	1,10 %
	IUP	0,54 % ⁵
	ZE	1,04 % ⁴
	ZEH	1,10 %
	ZEP	1,04 % ⁴
	ZF	1,10 %
	ZFP	1,10 %
	ZU	1,10 %
	ZUP	1,10 %
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	AEC	1,85 %
	AEH	1,85 %
	ASH	1,85 %
	AU	1,85 %
	AUP	1,85 %
	DEH	2,35 %
	DU	2,35 %
	IFH	1,05 %
	IU	1,05 %
	ZEH	1,10 %
	ZFH	1,10 %
	ZGH	1,10 %
	ZU	1,10 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities	AE	1,85 %
	ASH	1,85 %
	AUH	1,85 %
	DE	2,60 %
	IE	1,00 %
	W	1,75 %
	XE	0,15 %
	ZUH	1,11 % ³
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	AE	1,85 %
	ASH	1,85 %
	DE	2,75 %

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

19 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities		
(Fortsetzung)	IE	1,10 %
	W	1,90 %
Threadneedle (Lux) - European Select	AE	1,85 %
	AGH	1,35 % ^a
	AUH	1,35 % ^a
	IE	0,95 %
	ZGH	1,05 %
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	AEH	1,85 %
	AU	1,85 %
	DEH	2,85 %
	DU	2,85 %
	W	2,00 %
	ZGH	1,10 %
	ZUP	1,10 %
Threadneedle (Lux) - Greater China Equities	AEH	1,85 %
	AU	1,85 %
	DEH	2,85 %
	DU	2,85 %
	W	2,00 %
Threadneedle (Lux) - Global Energy Equities	AEH	2,07 % ³
	AU	2,07 % ³
	DEH	2,60 %
	DU	2,60 %
	W	1,75 %
Threadneedle (Lux) - Global Technology	AEH	2,07 % ³
	AU	2,00 %
	BU	2,35 %
	DU	2,35 %
	ZU	1,20 %
Threadneedle (Lux) - Mondrian Investment Partners – Focused Emerging Markets Equity	M ⁶	1,16 %
Threadneedle (Lux) - UK Equities	AEH	1,85 %
	AG	1,85 %
	AGP	1,85 %
	IEH	0,99 % ³
	IG	0,97 % ³
	IGP	0,98 % ³
	ZEH	1,10 %
	ZFH	1,10 %
	ZG	1,10 %
	ZGP	1,10 %
	ZUH	1,10 %
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	1,85 %
	AFH	1,85 %
	AGH	1,85 % / 1,96 % ⁷
	AU	1,85 % / 1,99 % ⁷
	DEH	2,35 %
	DU	2,35 %
	IEH	0,95 % / 1,22 % ⁷

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

19 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha		
(Fortsetzung)	IGH	0,95 % / 1,17 % ⁷
	IU	0,95 % / 1,77 % ⁷
	ZGH	1,05 %
Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia¹	AEC	1,50 %
	AEH	1,50 %
	DEH	2,25 %
	IEH	0,80 %
	IGH	0,80 %
	ISH	0,80 %
	IU	0,80 %
	IVH	0,80 %
	ZEH	1,00 %
	ZFH	1,00 %
	ZU	1,00 %
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond	AEH	1,30 %
	AGH	1,30 %
	AU	1,30 %
	DEH	2,20 %
	DU	2,20 %
	IEH	0,75 %
	IFH	0,75 %
	IU	0,75 %
	ZGH	0,80 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha¹	AE	1,85 % / 3,12 % ⁷
	AEP	1,85 % / 3,12 % ⁷
	AUH	1,85 % / 3,40 % ⁷
	DE	2,35 % / 3,52 % ⁷
	IE	0,95 % / 2,41 % ⁷
	IGH	0,95 % / 2,47 % ⁷
	LE	0,58 % / 2,11 % ⁷
	XGH	0,15 %
	ZE	1,05 % / 2,49 % ⁷
	ZGH	1,05 % / 2,58 % ⁷
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	AEH	2,10 %
	AFH	2,10 %
	AGH	2,10 %
	ASH	2,10 %
	AU	2,10 %
	DEH	2,60 %
	DU	2,60 %
	IEH	1,25 %
	IFH	1,25 %
	IGH	1,25 %
	IKH	1,25 %
	IU	1,25 %
	XGH	0,15 %
	XU	0,15 %
	ZEH	1,10 %
	ZFH	1,10 %
	ZGH	1,10 %
	ZU	1,10 %

Erläuterungen zum Jahresabschluss

(Fortsetzung)

19 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

¹ Siehe Erläuterung 1.

² Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund von Wertberichtigungen für Rückerstattungen von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.

³ Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des Rückgangs der Vermögensverwaltungsgebühren und der Betriebskosten während des Berichtszeitraums von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.

⁴ Aufgrund der Verwendung der Durchschnittsberechnungsmethode weicht die aktuelle Gesamtkostenquote der während des Jahres aufgelegten Anteilsklassen leicht von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab. Die Gebühren für diese Anteilsklassen übersteigen die erwartete Gesamtkostenquote nicht.

⁵ Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.

⁶ Depot- und Unterdepotgebühren werden dieser Anteilklasse zusätzlich berechnet.

⁷ Einschließlich Erfolgsgebühr.

⁸ Der Unterschied zwischen Gesamtkostenquote beim Vergleich mit AMC plus Betriebskosten entspricht einem Zuschlag von 50 BP, die von Columbia Threadneedle in die Anteilklasse gezahlt werden, was zu einer Gesamtkostenquote von 1,35 % anstatt 1,85 % führt.

20 EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG

Mit Wirkung zum 3. Oktober 2016 hat sich die Anlagepolitik des Threadneedle (Lux) - Mondrian Investment Partners - Focused Emerging Markets Equity Portfolio geändert, und der Name hat sich in Threadneedle (Lux) - Mondrian Investment Partners - Emerging Markets Equity geändert.

Das Threadneedle (Lux) - UK Equity Income Portfolio wurde am 5. Oktober 2016 aufgelegt.

Informationen für Anteilinhaber

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 Bekanntmachung enthält den Ort und Zeitpunkt der Versammlung, die Teilnahmebedingungen, die Tagesordnung, das Quorum und die Voraussetzungen für die Stimmabgabe.

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 konsolidierten Konten der SICAV werden 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.

Informationen für Anleger in der Schweiz

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, Badenerstrasse 567, Postfach 1292, CH-8048 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.

Verzeichnis

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
USA

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

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
Vereinigtes Königreich

Walter Scott & Partners Limited
1 Charlotte Square
Edinburgh EH2 4DR
Schottland

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

Verwaltungsgesellschaft

Threadneedle Management Luxembourg S.A.⁵
44, rue de la Vallée
L-2661 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Portfolio

Threadneedle (Lux) - Diversified Alternative Risk Premia⁵
Threadneedle (Lux) - Global Technology
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond⁵
Threadneedle (Lux) - US Investment Grade Corporate Bond⁵
Threadneedle (Lux) - Global Energy Equities
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

Threadneedle (Lux) - Global Strategic Bond²
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond²
Threadneedle (Lux) - Global Opportunities Bond³
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds²
Threadneedle (Lux) - Global Asset Allocation
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income³
Threadneedle (Lux) - Global Focus
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt²
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds²
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities
Threadneedle (Lux) - Pan European Equities
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha⁵
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income
Threadneedle (Lux) - American Select³
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities³
Threadneedle (Lux) - Greater China Equities
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha³
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities
Threadneedle (Lux) - UK Equities
Threadneedle (Lux) - American³
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies
Threadneedle (Lux) - European Select

Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity⁴
Threadneedle (Lux) - Asian Focus⁴
Threadneedle (Lux) - Developed Asia Growth and Income⁴

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

Threadneedle (Lux) - Global Equities - Walter Scott & Partners⁵

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

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

²Threadneedle Asset Management Limited kann vorbehaltlich seiner eigenen Haftung die diskretionäre Anlageverwaltung eines Teils des Portfoliovermögens an Columbia Management Investment Advisers, LLC delegieren.

³Columbia Management Investment Advisers, LLC gibt Threadneedle Asset Management Limited Anlageempfehlungen und stellt daher für Threadneedle Asset Management Limited eine auf Analysen gestützte Anlageberatung bereit.

⁴Columbia 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.

⁵Siehe Erläuterung 1.

Verzeichnis

(Fortsetzung)

Depotbank, 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

Threadneedle Management Luxembourg S.A.¹
44, rue de la Vallée
L-2661 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Unterbevollmächtigte:

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

Vertretung und Zahlstelle in Hongkong

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

Vertretung und Zahlstelle in der Schweiz

RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette
Zweigniederlassung Zürich
Badenerstrasse 567
Postfach 1292
CH-8048 Zürich
Schweiz

Abschlussprüfer

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

Rechtsberater in Luxemburg

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

Rechtsberater in Deutschland

Hengeler Mueller
Bockheimer Landstraße 24
D-60323 Frankfurt am Main
Deutschland

¹Siehe Erläuterung 1.

Weitere Informationen finden Sie auf unserer Website: columbiathreadneedle.com



Herausgegeben von Threadneedle Management Luxembourg S.A. Eingetragen im Registre de Commerce et des Societes (Luxemburg), Registernr. B 110242, 44, rue Mühlenweg, L-2661 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg. Im Vereinigten Königreich herausgegeben von Threadneedle Asset Management Limited (TAML). Eingetragen in England und Wales, Registernr. 573204, Cannon Place, 78 Cannon Street, London EC4N 6AG, Vereinigtes Königreich. Im Vereinigten Königreich von der Financial Conduct Authority autorisiert und beaufsichtigt. Columbia Threadneedle Investments ist der globale Markenname der Columbia and Threadneedle Unternehmensgruppe. columbiathreadneedle.com 160227